

南方高增长混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
8.6 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.....	62
8.7 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.....	62

8.8	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	62
8.9	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	62
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12	投资组合报告附注	63
§9	基金份额持有人信息	65
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2	期末上市基金前十名持有人	65
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
9.4	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	66
§10	开放式基金份额变动	67
§11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
11.2	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	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4	基金投资策略的改变	68
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8	其他重大事件	72
§12	备查文件目录	77
12.1	备查文件目录	77
12.2	存放地点	77
12.3	查阅方式	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方高增长混合型证券投资基金
基金简称	南方高增长混合(LOF)
场内简称	南方高增
基金主代码	160106
前端交易代码	160106
后端交易代码	160107
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年7月13日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,452,706,484.67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	2005年9月21日

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，以具有高成长性的公司为主要投资对象，力争为投资者寻求最高的超额回报。
投资策略	作为以高增长为目标的混合型基金，本基金在股票和可转债的投资中，采用“自下而上”的策略进行投资决策，以寻求超额收益。本基金选股主要依据南方基金公司建立的“南方高成长评价体系”，通过定量与定性相结合的评价方法，选择未来2年预期主营业务收入增长率和息税前利润增长率均超过GDP增长率3倍，且根据该体系，在全部上市公司中成长性和投

	资价值排名前 5% 的公司，或者是面临重大的发展机遇，具备超常规增长潜力的公司为主要投资对象，这类股票占全部股票市值的比例不低于 80%。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准采用上证综指，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。作为混合型基金，本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式：基金整体业绩基准 = 上证综指 × 90% + 上证国债指数 × 10%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	王永民
	联系电话	0755-82763888	010-66594896
	电子邮箱	manager@southernfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95566
传真		0755-82763889	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		张海波	田国立

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-227,366,251.32	1,378,410,891.74	573,057,748.69
本期利润	-277,117,204.16	1,110,568,644.11	717,188,364.44
加权平均基金份额本期利润	-0.1910	0.8289	0.3700
本期加权平均净值利润率	-14.89%	38.60%	25.20%
本期基金份额净值增长率	-11.98%	36.64%	28.90%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	416,234,677.19	1,318,433,191.34	1,366,512,717.56
期末可供分配基金份额利润	0.2865	1.2325	0.8119
期末基金资产净值	1,868,941,161.86	2,388,166,384.56	3,049,660,318.56
期末基金份额净值	1.2865	2.2325	1.8119
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	559.38%	649.10%	448.23%

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

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

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

3.2 基金净值表现

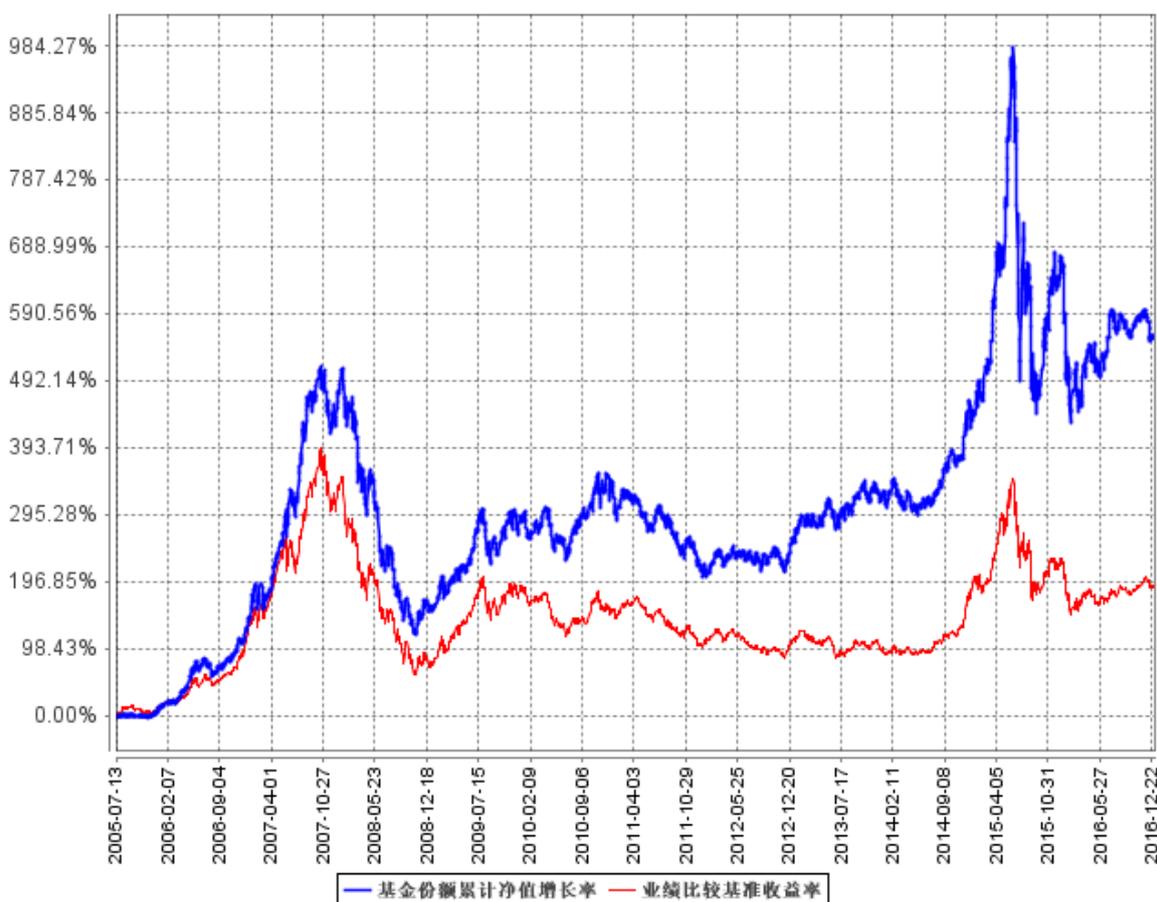
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.42%	0.64%	2.97%	0.62%	-3.39%	0.02%

过去六个月	0.71%	0.75%	5.50%	0.66%	-4.79%	0.09%
过去一年	-11.98%	1.71%	-10.64%	1.31%	-1.34%	0.40%
过去三年	55.03%	2.03%	44.59%	1.58%	10.44%	0.45%
过去五年	106.85%	1.74%	40.87%	1.38%	65.98%	0.36%
自基金合同生效起至今	559.38%	1.70%	188.02%	1.56%	371.36%	0.14%

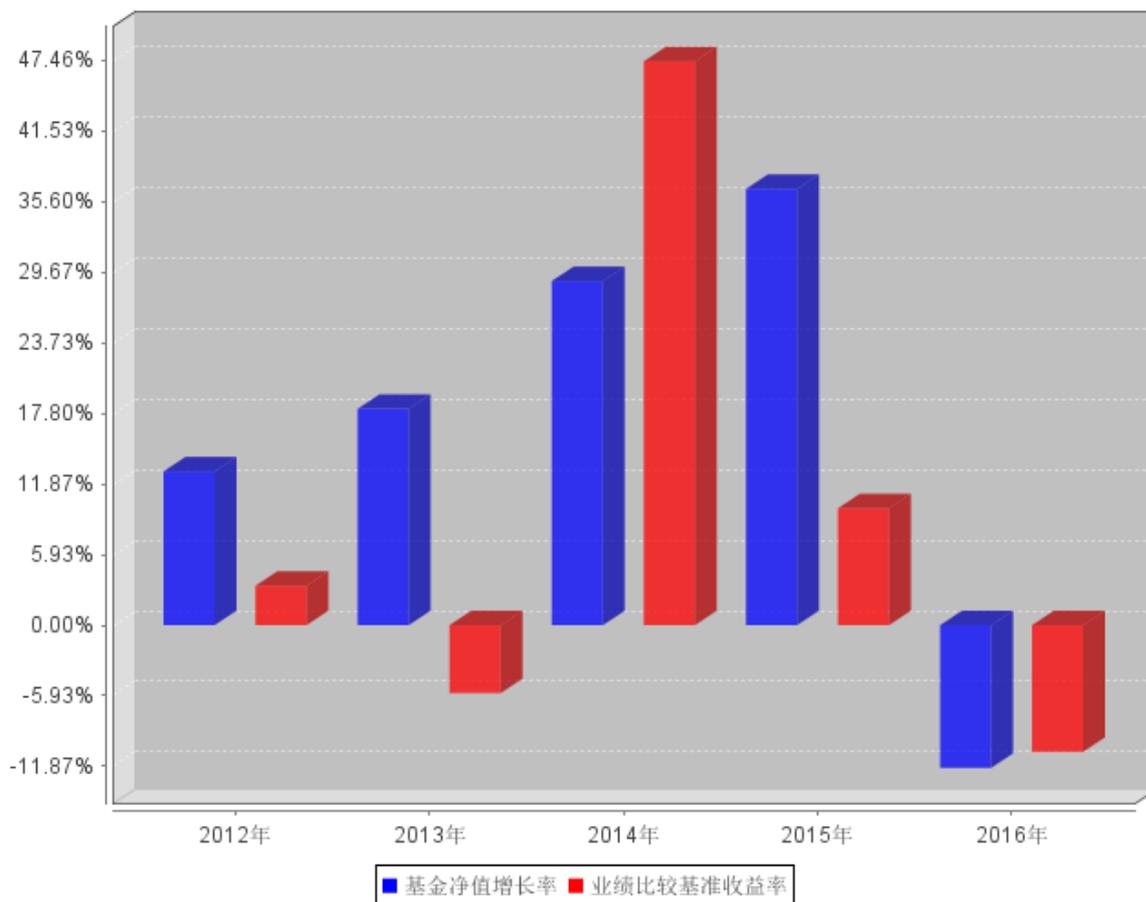
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：根据本基金合同，本基金的投资标的物包括国内依法公开发行的各类股票、债券及其他金融工具，其中股票（含可转债）的投资比例为60%—95%。截止报告期末，本基金股票投资比例为87.43%，符合基金合同的要求。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份 额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合计	备注
2016	6.4500	256,959,815.76	434,409,886.96	691,369,702.72	注：本期 分红一次
2015	1.8000	108,316,823.11	186,179,026.21	294,495,849.32	注：本期 分红一次
2014	1.6000	146,250,391.94	182,166,531.75	328,416,923.69	注：本期 分红一次

合 计	9.8500	511,527,030.81	802,755,444.92	1,314,282,475.73	
--------	--------	----------------	----------------	------------------	--

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张原	本基金 基金经 理	2011年 2月17日	-	10年	美国密歇根大学经济学硕士学位，具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金，曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员，南方高增及南方隆元基金经理助理；现任投资部副总监、境内权益投资决策委员会委员、FOF投资决策委员会委员、社保理事会委托产品投资决策委员会委员；2009年9月至2013年4月，任南方500基金经理；2010年2月至2016年10月，任南方绩优基金经理；2011年2月至今，任南方高增基金经理；2015年12月至今，任南方成份基金经理。
林乐峰	本基金	2015年	2016年	8年	北京大学概率论与数理统计专业硕士，具有基

	基金经 理助理	2 月 26 日	3 月 30 日		金从业资格，2008 年 7 月加入南方基金，任研究部研究员、高级研究员，负责钢铁、机械制造、中小市值的行业研究；2015 年 2 月至 2016 年 3 月 30 日，担任南方高增长基金经理助理。
--	------------	----------	----------	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------

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合规守信情况的说明

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《南方高增长混合型证券投资基金》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年，中国经济增速前低后高，从年度来看继续处在下降通道中，全年增速6.7%创下多年来低谷。年初本基金管理组对于2016年全年的判断是：2016年市场的机会存在，但企业盈利、无风险利率、风险偏好几大因素的边际改善弱于2015年，因此应放低收益率预期，同时要回归对企业盈利的重视。我们认为应该保持中性合理的仓位，灵活应对市场波动。回顾2016年宏观经济走势，基本验证了本基金管理组年初的判断，经济增速中枢进一步下移，资金面也从年初的宽松逐渐向年底的稳健转变，利率由降转升、风险偏好也在持续下降。

2016年的A股市场年初经历了大幅波动，之后随着汇率走稳市场情绪逐渐平复，股市逐渐开始震荡上行，总体波动幅度趋缓。全年来看，上证指数下跌12%，大盘蓝筹股为代表的沪深300下跌11%。而创业板指数全年下跌28%、中小板指数全年下跌23%，成长股的估值水平大幅下降。南方高增长基金在全年的投资中有得有失，继续坚持研究为本，积极挖掘高增长潜力的公司，保持精选个股的成长型投资风格，并结合对宏观和产业链的预判，在黄金、养殖等行业的投资上取得了较为理想的结果，但在熟悉的新兴成长领域，受市场风格变化未能获得较好的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.2865元，本报告期份额净值增长率为-11.98%，同期业绩比较基准增长率为-10.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从近期各项经济数据来看，总体宏观经济处于平稳状态，短期略有回升。

2016年GDP增速6.7%，较2015年6.9%的增速继续回落，体现了中国经济结构转型期的特

点。分季度来看，2016 年的四个季度分别是 6.7%、6.7%、6.7%、6.8%，四季度经济增速出现小幅回升。

从物价数据来看，2016 年 12 月 CPI 同比回落至 2.1%，仍处于可控的范围内。而随着大宗商品的上涨，PPI 同比继续攀升至 5.5%，这有利于工业企业尤其是中游制造业的盈利恢复。

固定资产投资方面，2016 年 12 月增速 6.3%，其中制造业投资增速见底回升达到至 10.3%，房地产投资增速也反弹至 11.1%，基建投资增速下滑至 4.3%。总体来看，投资对 GDP 的贡献处于逐年下降的通道中。

金融数据方面，2016 年 12 月 M2 同比增长 11.3%，全年增速低于年初 13% 的目标。12 月新增社融 1.63 亿，新增金融机构贷款 1.04 万亿，短期信贷需求仍在。结合 1 月份可能超预期的信贷数据，短期投资需求仍可维持。

其他重要经济先行指标来看，2016 年 12 月制造业 PMI 略有回落至 51.4，仍然维持连续 5 个月高于荣枯线，说明经济仍处于扩张区间。不过在严厉政策的调控下，房地产销售正在走弱，可能对远期经济带来隐忧。

展望 2017 年宏观经济走势，预计将呈现前高后低的走势，整体趋于平稳。

从一季度来看，随着大宗商品价格的持续反弹，PPI 继续上升，带动工业企业利润回暖，同时叠加补库存效应，宏观经济的阶段性反弹预计将持续 1~2 个季度，总体来看能持续到上半年。但是到 2017 年下半年，随着基数的明显抬升，同时房地产调控滞后的效应逐渐体现，宏观经济可能会再次出现反复的风险。因此，全年来看宏观经济节奏应该是前高后低。从中长期来看，增速中枢继续下移是大概率事件。

2017 年通胀阶段性高点可能在 1 月份出现，主要叠加低基数原因以及春节因素，之后应该会回落到可控范围。细分影响因素来看，猪料产量接近历史最高预示猪供给提升，猪价难有大涨的空间。大宗商品来看，除去原油的商品同比涨幅高点已过，原油看同比有较大涨幅，但随着油价逼近页岩油成本线，也不具备环比继续涨价的基础。猪价和油价不会贡献新的涨价因素，但前期油价及工业品价格涨幅正在逐渐向 CPI 上传导，近期部分农产品、消费品价格出现上涨，因此对 CPI 仍需要提防超预期上行影响货币政策的风险。

政策方面，预计央行在 2017 年将保持货币政策稳健中性，监管层已经将工作重点聚焦在去杠杆控风险上。前期债券收益率的快速提升，不仅来自美国利率的上升，也来自国内央行态度的转变，从 2016 年 10 月 28 日政治局会议弱化保增长强调控风险，到央行反思利率走廊制提供了过量流动性纵容加杠杆，到中央经济工作会议最终确定去杠杆。2017 年 1 月 24 日，央行自 MLF 工具创设以来首次上调 MLF 利率 10 个 BP，实现了变相加息。幅度虽然不大，但体现了监管

层去杠杆抑泡沫的决心。

对 A 股市场来看，我们预计 2017 年仍处于震荡市，继续寻找结构性机会。

从企业盈利端来看，随着 PPI 的上升，工业企业盈利继续复苏。从上市公司的角度来看，业绩改善幅度较大的主要集中在周期性行业，时间主要在 2017 年上半年。如前所述，我们认为 2017 年下半年宏观经济有一些不确定性，因此企业盈利在下半年的表现有待观察。

货币政策的中性使得整体估值中枢难以提升。从当前估值来看，A 股的 PE 估值水平相比高点已有较大幅度回调。沪深 300 估值处于较低水平，创业板绝对估值仍不便宜，但相对历史平均已有折价。中长期看，潜在配置在股市上的增量资金需求仍存在，但短期由于控风险抑泡沫等种种原因导致入市节奏放缓。

下一阶段市场潜在的风险，我们认为最重要的在两个方面。一个来自内部，PPI 对 CPI 的传导有待观察，央行对 MLF 的利率上调是个信号，如果利率上行超预期，股票市场将面临较大压力。另一个来自外部，特朗普上任后，人民币汇率、中美外贸、南海周边摩擦等都存在不确定风险。短期需要观察风险释放的进展。

结构上来看，未来一段时间在整体估值中枢难以提升的情况下，业绩增长的确定性成为选股的重要标准，景气度继续向上的周期股以及估值合理的白马成长股是配置方向。等到补库存周期结束经济自然回落时，受益经济结构转型的新兴高成长个股会重新受到青睐，届时我们将密切关注市场风格转换的进度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，推动公司合规、内控体系的健全完善；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评

估及相关控制措施的研究与落实，有效确保投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实销售适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，积极推进符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，健全创新业务洗钱风险评估机制，各项反洗钱工作进一步完善；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 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，组成人员包括副总经理、研究部总监、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。

4.8 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：基金收益分配采用现金方式，投资人可选择获取现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；每一基金份额享有同等分配权；基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多四次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的50%。成立不满三个月，收益可不分配。法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本基金于 2017 年 1 月 18 日进行本基金的 2016 年年度收益分配（每 10 份基金份额派发红利 0.20 元）。

本报告期内 2016 年 1 月 20 日已分配数（每 10 份基金份额派发红利 6.45 元）为以往年度收益分配。

4.9 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南方高增长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21471 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方高增长混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的南方高增长混合型证券投资基金(以下简称“南方高增长基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是南方高增长基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括</p>

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方高增长混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	138,822,552.31	241,425,624.51
结算备付金		4,228,574.65	14,086,269.66
存出保证金		829,502.45	1,726,508.46
交易性金融资产	7.4.7.2	1,735,135,124.67	2,179,671,968.95
其中：股票投资		1,644,598,619.67	2,079,541,968.95
基金投资		-	-
债券投资		90,536,505.00	100,130,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,200,648.52	1,329,474.34
应收股利		-	-
应收申购款		808,098.01	209,961.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,881,024,500.61	2,438,449,807.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,240,722.12	36,597,780.91
应付赎回款		960,045.90	1,859,735.30
应付管理人报酬		2,398,494.24	3,071,468.11
应付托管费		399,749.04	511,911.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,790,347.10	8,046,810.36
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	293,980.35	195,716.49
负债合计		12,083,338.75	50,283,422.52
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,452,706,484.67	1,069,733,193.22
未分配利润	7.4.7.10	416,234,677.19	1,318,433,191.34
所有者权益合计		1,868,941,161.86	2,388,166,384.56
负债和所有者权益总计		1,881,024,500.61	2,438,449,807.08

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2865 元，基金份额总额 1,452,706,484.67 份。

7.2 利润表

会计主体：南方高增长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016年1月1日至 2016年12月31日	2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		-220,060,062.94	1,214,326,098.66
1. 利息收入		2,836,780.48	3,252,313.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,361,350.11	2,471,951.86
债券利息收入		123,148.55	706,885.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		352,281.82	73,476.17
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-173,305,507.06	1,477,705,239.64
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-184,019,922.93	1,463,659,947.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	79,300.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	10,635,115.87	14,045,292.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-49,750,952.84	-267,842,247.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	159,616.48	1,210,793.37
减：二、费用		57,057,141.22	103,757,454.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,895,666.74	43,009,953.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,649,277.81	7,168,325.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	24,000,709.26	53,058,217.71

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	511,487.41	520,958.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-277,117,204.16	1,110,568,644.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-277,117,204.16	1,110,568,644.11

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方高增长混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,069,733,193.22	1,318,433,191.34	2,388,166,384.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-277,117,204.16	-277,117,204.16
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）	382,973,291.45	66,288,392.73	449,261,684.18
其中：1. 基金申购款	541,918,452.09	117,487,441.66	659,405,893.75
2. 基金赎回款	-158,945,160.64	-51,199,048.93	-210,144,209.57
四、本期向基金份额持有	-	-691,369,702.72	-691,369,702.72

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）	1,452,706,484.67	416,234,677.19	1,868,941,161.86
项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,683,147,601.00	1,366,512,717.56	3,049,660,318.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,110,568,644.11	1,110,568,644.11
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）	-613,414,407.78	-864,152,321.01	-1,477,566,728.79
其中：1. 基金申购款	486,573,935.44	532,623,951.63	1,019,197,887.07
2. 基金赎回款	-1,099,988,343.22	-1,396,776,272.64	-2,496,764,615.86
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）	-	-294,495,849.32	-294,495,849.32
五、期末所有者权益（基金净值）	1,069,733,193.22	1,318,433,191.34	2,388,166,384.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方高增长混合型证券投资基金(原名为南方高增长证券投资基金,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”)证监基金字[2005]第82号《关于同意南方高增长证券投资基金募集的批复》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《南方高增长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人民币1,276,503,292.69元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京(验)报字(05)第011号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方高增长证券投资基金基金合同》于2005年7月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,276,869,477.13份基金份额,其中认购资金利息折合366,184.44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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]82号文审核同意,本基金176,594,255.00份基金份额于2005年9月21日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,南方高增长证券投资基金于2015年8月7日公告后更名为南方高增长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方高增长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,其中股票(含可转换债券)的投资比例为60%-95%。本基金的业绩比较基准为:上证综指×90%+上证国债指数×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于2017年3月24日批准报出。

7.4.2 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》、《南方高增长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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和债券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。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和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其他各类应付款项等。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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，其中场外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，场内基金份额持有人只能选择现金分红。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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

(3) 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016年12月31日	2015年12月31日
活期存款	138,822,552.31	241,425,624.51
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	138,822,552.31	241,425,624.51

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,601,637,500.71	1,644,598,619.67	42,961,118.96
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	175,000.00	197,505.00
	银行间市场	90,278,310.00	90,339,000.00
	合计	90,453,310.00	90,536,505.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,692,090,810.71	1,735,135,124.67	43,044,313.96
项目	上年度末		
	2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,986,880,702.15	2,079,541,968.95	92,661,266.80
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-

	银行间市场	99,996,000.00	100,130,000.00	134,000.00
	合计	99,996,000.00	100,130,000.00	134,000.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	2,086,876,702.15	2,179,671,968.95	92,795,266.80

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	38,209.70	38,424.21
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	1,902.90	6,338.80
应收债券利息	1,160,162.62	1,283,934.43
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	373.30	776.90
合计	1,200,648.52	1,329,474.34

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,789,672.10	8,046,810.36
银行间市场应付交易费用	675.00	-
合计	2,790,347.10	8,046,810.36

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,980.35	3,716.49
预提费用	291,000.00	192,000.00
-	-	-
合计	293,980.35	195,716.49

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,069,733,193.22	1,069,733,193.22
本期申购	541,918,452.09	541,918,452.09
本期赎回(以“-”号填列)	-158,945,160.64	-158,945,160.64
本期末	1,452,706,484.67	1,452,706,484.67

注：

1. 申购含红利再投份额。

2. 截至 2016 年 12 月 31 日止, 本基金于深交所上市的基金份额为 66,507,513.00 份(2015 年 12 月 31 日: 54,551,982.00 份), 托管在场外未上市交易的基金份额为 1,386,198,971.67 份(2015 年 12 月 31 日: 1,015,181,211.22 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统, 可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回; 未上市的基金份额登记在注册登记系统, 按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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
上年度末	1,725,513,962.62	-407,080,771.28	1,318,433,191.34
本期利润	-227,366,251.32	-49,750,952.84	-277,117,204.16
本期基金份额交易产生的变动数	294,864,390.23	-228,575,997.50	66,288,392.73
其中: 基金申购款	417,368,245.27	-299,880,803.61	117,487,441.66
基金赎回款	-122,503,855.04	71,304,806.11	-51,199,048.93
本期已分配利润	-691,369,702.72	-	-691,369,702.72
本期末	1,101,642,398.81	-685,407,721.62	416,234,677.19

7.4.7.11 存款利息收入

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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,220,935.13	2,197,410.97
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	117,697.25	226,707.86
其他	22,717.73	47,833.03
合计	2,361,350.11	2,471,951.86

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
卖出股票成交总额	8,043,249,859.78	18,246,028,520.77
减：卖出股票成本总额	8,227,269,782.71	16,782,368,573.49
买卖股票差价收入	-184,019,922.93	1,463,659,947.28

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	101,431,365.57	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	99,996,000.00	-
减：应收利息总额	1,356,065.57	-
买卖债券差价收入	79,300.00	-

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	10,635,115.87	14,045,292.36

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	10,635,115.87	14,045,292.36

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-49,750,952.84	-267,842,247.63
——股票投资	-49,700,147.84	-267,976,247.63
——债券投资	-50,805.00	134,000.00
——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	-49,750,952.84	-267,842,247.63

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
基金赎回费收入	159,616.48	1,210,793.37
证管费退还	-	-
其他	-	-
合计	159,616.48	1,210,793.37

注：本基金场内部分的赎回费率为0.5%，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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
交易所市场交易费用	23,999,634.26	53,057,817.71
银行间市场交易费用	1,075.00	400.00
合计	24,000,709.26	53,058,217.71

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
审计费用	91,000.00	92,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
交易费用	200.00	-
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	23,087.41	41,308.13
债券托管账户维护费	37,200.00	27,650.00
其他	-	-
合计	511,487.41	520,958.13

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 本基金的基金管理人于2017年1月13日宣告2016年度第一次分红，向截至2017年1月18日止在本基金注册登记人登记在册的全体份额持有人，按每10份基金份额派发红利

0.2000元。

2. 财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号),要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人,自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号),2017年7月1日(含)以后,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法,由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华泰证券	46,067,327.08	0.29%	398,368,569.89	1.15%
兴业证券	680,959,219.55	4.29%	1,572,714,875.42	4.55%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	41,980.46	0.29%	41,980.46	1.50%
兴业证券	620,559.67	4.27%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	352,516.48	1.13%	-	-
兴业证券	1,399,425.92	4.48%	266,780.78	3.32%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	27,895,666.74	43,009,953.15
其中：支付销售机构的客户维护费	3,744,302.93	5,654,187.10

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。

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,649,277.81	7,168,325.56

注：支付基金托管人中国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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行	138,822,552.31	2,220,935.13	241,425,624.51

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国银行 保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每10份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年1月 20日	2016年 1月 21日	2016 年 1月 20日	6.4500	256,959,815.76	434,409,886.96	691,369,702.72	
合 计	-	-		6.4500	256,959,815.76	434,409,886.96	691,369,702.72	

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后、报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见附注7.4.8.2资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 股	成本总额	额	
601375	中原 证券	2016 年 12月 20日	2017 年 1月 3日	新股未 上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺 电子	2016 年 12月 28日	2017 年 1月 6日	新股未 上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平 鸟	2016 年 12月 29日	2017 年 1月 9日	新股未 上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托 生物	2016 年 12月 29日	2017 年 1月 6日	新股未 上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天 燃气	2016 年 12月 30日	2017 年 1月 10日	新股未 上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟 汽饰	2016 年 12月 27日	2017 年 1月 5日	新股未 上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙 股份	2016 年 12月	2017 年 1月	新股未 上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-

		30日	10日							
002840	华统股份	2016年 12月 29日	2017年 1月 10日	新股未 上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年 12月 28日	2017年 1月 6日	新股未 上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年 12月 26日	2017年 1月 3日	新股未 上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年 12月 27日	2017年 1月 5日	新股未 上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年 12月 26日	2017年 1月 4日	新股未 上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年 12月 30日	2017年 1月 10日	新股未 上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年 12月 27日	2017年 1月 5日	新股未 上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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

7.4.12.2 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
600797	浙大网新	2016年10月27日	重大资产重组	16.21	2017年1月6日	17.95	4,500,072	56,778,762.64	72,946,167.12	-
600151	航天机电	2016年11月11日	重大资产重组	10.04	-	-	1,800,000	20,417,507.89	18,072,000.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“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。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于2016年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.01%(2015年12月31日：无)。

7.4.13.3 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。本基金持有一家公司发行的证券，其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7.4.12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12月31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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	138,822,552.31	-	-	-	138,822,552.31
结算备付金	4,228,574.65	-	-	-	4,228,574.65
存出保证金	829,502.45	-	-	-	829,502.45
交易性金融资产	90,339,000.00	-197,505.00	1,644,598,619.67		1,735,135,124.67
应收利息	-	-	-	1,200,648.52	1,200,648.52
应收申购款	8,646.99	-	-	799,451.02	808,098.01
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	234,228,276.40	-197,505.00	1,646,598,719.21		1,881,024,500.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,240,722.12	5,240,722.12
应付赎回款	-	-	-	960,045.90	960,045.90
应付管理人报酬	-	-	-	2,398,494.24	2,398,494.24
应付托管费	-	-	-	399,749.04	399,749.04
应付交易费用	-	-	-	2,790,347.10	2,790,347.10
其他负债	-	-	-	293,980.35	293,980.35
负债总计	-	-	-	12,083,338.75	12,083,338.75
利率敏感度缺口	234,228,276.40	-197,505.00	1,634,515,380.46		1,868,941,161.86
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	241,425,624.51	-	-	-	241,425,624.51
结算备付金	14,086,269.66	-	-	-	14,086,269.66
存出保证金	1,726,508.46	-	-	-	1,726,508.46
交易性金融资产	100,130,000.00	-	-	-2,079,541,968.95	2,179,671,968.95
应收利息	-	-	-	1,329,474.34	1,329,474.34
应收申购款	35,562.92	-	-	174,398.24	209,961.16
资产总计	357,403,965.55	-	-	-2,081,045,841.53	2,438,449,807.08
负债					
应付证券清算款	-	-	-	36,597,780.91	36,597,780.91
应付赎回款	-	-	-	1,859,735.30	1,859,735.30
应付管理人报酬	-	-	-	3,071,468.11	3,071,468.11
应付托管费	-	-	-	511,911.35	511,911.35
应付交易费用	-	-	-	8,046,810.36	8,046,810.36
其他负债	-	-	-	195,716.49	195,716.49
负债总计	-	-	-	50,283,422.52	50,283,422.52
利率敏感度缺口	357,403,965.55	-	-	-2,030,762,419.01	2,388,166,384.56

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2016年12月31日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.84%(2015年12月31日：4.19%)，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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项

的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票(含可转换债券)的投资比例为60%-95%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	1,644,598,619.67	88.00	2,079,541,968.95	87.08
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	1,644,598,619.67	88.00	2,079,541,968.95	87.08

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
		1. 沪深300指数上升5%	增加约7,006
2. 沪深300指数下降5%	减少约7,006	减少约11,733	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,553,308,563.22元，属于第二层次的余额为181,826,561.45元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次1,954,571,107.08元，第二层次225,100,861.87元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,644,598,619.67	87.43
	其中：股票	1,644,598,619.67	87.43
2	固定收益投资	90,536,505.00	4.81
	其中：债券	90,536,505.00	4.81
	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	143,051,126.96	7.60
7	其他各项资产	2,838,248.98	0.15
8	合计	1,881,024,500.61	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	64,291,757.26	3.44
B	采矿业	124,134,000.00	6.64
C	制造业	763,715,277.23	40.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供	37,917.66	0.00

	应业		
E	建筑业	87,765,592.23	4.70
F	批发和零售业	89,445,465.64	4.79
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,075,459.32	5.46
J	金融业	201,301,571.68	10.77
K	房地产业	119,970,119.97	6.42
L	租赁和商务服务业	28,600,000.00	1.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	63,252,000.00	3.38
S	综合	-	-
	合计	1,644,598,619.67	88.00

8.3 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	600547	山东黄金	3,400,000	124,134,000.00	6.64
2	600266	北京城建	9,000,009	119,970,119.97	6.42
3	600682	南京新百	2,399,932	89,445,465.64	4.79
4	300202	聚龙股份	3,199,916	78,717,933.60	4.21
5	600797	浙大网新	4,500,072	72,946,167.12	3.90

6	000998	隆平高科	3,000,082	64,291,757.26	3.44
7	000662	天夏智慧	2,999,961	63,869,169.69	3.42
8	601801	皖新传媒	3,600,000	63,252,000.00	3.38
9	601166	兴业银行	3,600,000	58,104,000.00	3.11
10	000063	中兴通讯	3,599,985	57,419,760.75	3.07
11	000059	华锦股份	4,800,070	57,120,833.00	3.06
12	300161	华中数控	2,100,000	54,600,000.00	2.92
13	002117	东港股份	1,800,000	53,910,000.00	2.88
14	600079	人福医药	2,399,994	47,879,880.30	2.56
15	300408	三环集团	3,000,000	47,640,000.00	2.55
16	601939	建设银行	8,700,044	47,328,239.36	2.53
17	300145	中金环境	1,500,000	39,150,000.00	2.09
18	300401	花园生物	1,000,000	37,970,000.00	2.03
19	600105	永鼎股份	3,600,000	37,188,000.00	1.99
20	002142	宁波银行	2,206,163	36,710,552.32	1.96
21	000070	特发信息	1,200,048	30,349,213.92	1.62
22	600502	安徽水利	3,000,000	29,940,000.00	1.60
23	600643	爱建集团	2,400,000	29,784,000.00	1.59
24	601009	南京银行	2,700,000	29,268,000.00	1.57
25	300033	同花顺	420,000	28,887,600.00	1.55
26	002712	思美传媒	1,000,000	28,600,000.00	1.53
27	000687	华讯方舟	1,800,000	27,648,000.00	1.48
28	002383	合众思壮	540,000	26,730,000.00	1.43
29	000565	渝三峡A	2,100,000	26,439,000.00	1.41
30	000860	顺鑫农业	1,000,000	22,000,000.00	1.18
31	600820	隧道股份	1,800,000	19,818,000.00	1.06
32	000498	山东路桥	2,400,000	19,032,000.00	1.02
33	600039	四川路桥	4,000,000	18,960,000.00	1.01

34	002019	亿帆医药	1,200,010	18,348,152.90	0.98
35	600151	航天机电	1,800,000	18,072,000.00	0.97
36	603528	多伦科技	267,509	17,481,713.15	0.94
37	300011	鼎汉技术	13,740	284,692.80	0.02
38	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
39	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
40	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
41	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
42	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
43	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
44	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
45	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
46	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
47	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
48	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
49	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
50	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
51	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
52	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
53	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
54	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
55	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
56	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
57	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
58	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
59	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
60	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
61	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

62	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
63	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600266	北京城建	263,403,241.33	11.03
2	600489	中金黄金	132,652,046.23	5.55
3	300408	三环集团	131,369,738.71	5.50
4	600570	恒生电子	131,182,265.30	5.49
5	601801	皖新传媒	125,467,068.80	5.25
6	600682	南京新百	121,560,263.21	5.09
7	600547	山东黄金	121,414,205.85	5.08
8	002539	云图控股	119,575,134.46	5.01
9	000059	华锦股份	107,459,989.18	4.50
10	000975	银泰资源	105,603,254.11	4.42
11	300033	同花顺	102,464,211.68	4.29
12	002477	雏鹰农牧	96,844,491.34	4.06
13	300078	思创医惠	94,027,833.67	3.94
14	000662	天夏智慧	93,607,040.83	3.92
15	002368	太极股份	91,581,507.28	3.83
16	300496	中科创达	90,835,218.10	3.80
17	300161	华中数控	89,903,768.32	3.76
18	601939	建设银行	84,812,527.37	3.55
19	002142	宁波银行	83,953,786.52	3.52

20	600073	上海梅林	80,029,291.98	3.35
21	002124	天邦股份	79,952,659.13	3.35
22	002712	思美传媒	78,438,250.73	3.28
23	300401	花园生物	74,406,102.28	3.12
24	000860	顺鑫农业	73,867,891.99	3.09
25	300202	聚龙股份	73,300,436.71	3.07
26	600502	安徽水利	72,573,567.50	3.04
27	300031	宝通科技	71,971,599.64	3.01
28	601009	南京银行	70,039,664.40	2.93
29	000970	中科三环	69,135,691.47	2.89
30	002117	东港股份	67,052,174.10	2.81
31	002618	丹邦科技	65,873,644.97	2.76
32	000960	锡业股份	65,288,461.15	2.73
33	000895	双汇发展	64,359,277.31	2.69
34	600797	浙大网新	64,178,426.36	2.69
35	002234	民和股份	63,666,791.31	2.67
36	002299	圣农发展	62,852,551.78	2.63
37	000998	隆平高科	62,792,949.80	2.63
38	002514	宝馨科技	60,506,494.30	2.53
39	000063	中兴通讯	59,819,410.82	2.50
40	601166	兴业银行	58,820,807.03	2.46
41	000988	华工科技	57,720,848.85	2.42
42	300458	全志科技	56,971,907.48	2.39
43	000687	华讯方舟	56,571,951.24	2.37
44	002301	齐心集团	56,545,064.26	2.37
45	300359	全通教育	54,543,819.07	2.28
46	300253	卫宁健康	54,030,444.51	2.26
47	002643	万润股份	53,996,838.98	2.26

48	000703	恒逸石化	53,951,668.01	2.26
49	300128	锦富新材	52,841,251.42	2.21
50	600892	大晟文化	52,583,727.68	2.20
51	600765	中航重机	50,170,815.94	2.10
52	000750	国海证券	49,632,259.89	2.08
53	601668	中国建筑	48,383,484.75	2.03
54	300113	顺网科技	48,290,058.68	2.02
55	600079	人福医药	48,022,816.77	2.01

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。

8.4.2 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	600266	北京城建	188,172,197.86	7.88
2	601801	皖新传媒	159,799,714.03	6.69
3	600570	恒生电子	159,457,006.93	6.68
4	601668	中国建筑	155,393,002.09	6.51
5	002124	天邦股份	154,886,698.55	6.49
6	600489	中金黄金	130,390,107.13	5.46
7	002547	春兴精工	119,799,137.20	5.02
8	002539	云图控股	109,974,862.11	4.60
9	000975	银泰资源	108,893,733.00	4.56
10	002368	太极股份	104,723,693.20	4.39
11	001979	招商蛇口	98,459,041.36	4.12
12	300078	思创医惠	95,465,301.67	4.00
13	002477	雏鹰农牧	91,682,646.48	3.84
14	300496	中科创达	89,528,038.00	3.75

15	600592	龙溪股份	86,931,745.71	3.64
16	300031	宝通科技	84,173,064.65	3.52
17	002234	民和股份	81,598,527.00	3.42
18	600073	上海梅林	79,650,680.68	3.34
19	002618	丹邦科技	74,508,035.83	3.12
20	300033	同花顺	73,716,713.44	3.09
21	300145	中金环境	72,177,528.80	3.02
22	300408	三环集团	72,111,550.45	3.02
23	002299	圣农发展	71,130,799.37	2.98
24	002236	大华股份	70,436,074.29	2.95
25	000687	华讯方舟	69,533,781.02	2.91
26	000895	双汇发展	69,418,855.86	2.91
27	600547	山东黄金	68,918,494.00	2.89
28	002370	亚太药业	66,748,004.13	2.79
29	300206	理邦仪器	65,561,753.27	2.75
30	000060	中金岭南	65,220,635.72	2.73
31	000960	锡业股份	65,200,709.62	2.73
32	002643	万润股份	64,895,160.40	2.72
33	000970	中科三环	64,054,035.94	2.68
34	600892	大晟文化	63,483,781.35	2.66
35	000988	华工科技	61,770,575.91	2.59
36	002514	宝馨科技	61,769,509.82	2.59
37	600030	中信证券	60,645,492.42	2.54
38	600160	巨化股份	59,858,006.36	2.51
39	000059	华锦股份	57,087,939.09	2.39
40	002301	齐心集团	56,408,506.86	2.36
41	002587	奥拓电子	56,004,369.06	2.35
42	000703	恒逸石化	55,825,362.77	2.34

43	600765	中航重机	54,221,197.31	2.27
44	000488	晨鸣纸业	53,863,478.40	2.26
45	002712	思美传媒	53,843,898.51	2.25
46	002142	宁波银行	53,399,926.39	2.24
47	000860	顺鑫农业	53,279,515.62	2.23
48	300458	全志科技	52,451,373.74	2.20
49	600682	南京新百	52,221,869.98	2.19
50	002175	东方网络	52,103,161.33	2.18
51	603123	翠微股份	50,823,424.38	2.13
52	300049	福瑞股份	50,470,278.25	2.11
53	300128	锦富新材	50,005,298.02	2.09
54	600123	兰花科创	49,664,973.39	2.08
55	002335	科华恒盛	49,472,625.60	2.07
56	000750	国海证券	48,352,239.48	2.02
57	300113	顺网科技	48,212,057.36	2.02

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。

8.4.3 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	7,842,026,581.27
卖出股票收入（成交）总额	8,043,249,859.78

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。

8.5 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	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,339,000.00	4.83
	其中：政策性金融债	90,339,000.00	4.83
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）	197,505.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,536,505.00	4.84

8.6 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	140220	14 国开 20	300,000	30,252,000.00	1.62
2	140225	14 国开 25	300,000	30,231,000.00	1.62
3	120234	12 国开 34	300,000	29,856,000.00	1.60
4	128013	洪涛转债	1,750	197,505.00	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	829,502.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,200,648.52
5	应收申购款	808,098.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,838,248.98

8.12.4 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。

8.12.5 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	600797	浙大网新	72,946,167.12	3.90	重大资产重组

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
54,813	26,502.96	1,371,341.01	0.09%	1,451,335,143.66	99.91%

9.2 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	苗春波	3,188,918.00	4.79%
2	张伟彬	1,371,000.00	2.06%
3	曾立志	1,250,000.00	1.88%
4	郭红斌	1,083,299.00	1.63%
5	张香芝	782,037.00	1.18%
6	施建昌	701,379.00	1.05%
7	陈文荪	488,474.00	0.73%
8	杨主恩	480,000.00	0.72%
9	孙涛	471,724.00	0.71%
10	杨宏	387,767.00	0.58%

9.3 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	1,704,367.57	0.1173%

9.4 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年7月13日）基金份额总额	1,276,869,477.13
本报告期期初基金份额总额	1,069,733,193.22
本报告期基金总申购份额	541,918,452.09
减:本报告期基金总赎回份额	158,945,160.64
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	1,452,706,484.67

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

根据南方基金管理有限公司第七届董事会第一次会议审议通过，并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，自 2016 年 10 月 18 日起，张海波先生担任本基金管理人董事长，吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。

基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会任期届满，根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定，公司股东会 2016 年第一次临时会议选举产生了公司第七届董事会。

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第二十八次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于 2016 年 10 月 19 日发布公告，自 2016 年 10 月 17 日起，郑文祥先生不再担任本基金管理人副总经理。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 91000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 11 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信证券	1	11,790,181,732.78	11.27%	1,631,395.35	11.21%	-
英大证券	1	11,636,456,579.77	10.31%	1,506,060.01	10.35%	-
长江证券	1	11,610,256,356.70	10.14%	1,467,429.09	10.09%	-
天风证券	1	11,595,845,192.94	10.05%	1,454,296.27	10.00%	-
银河证券	1	11,489,876,294.00	9.38%	1,357,727.55	9.33%	-
万和证券	1	11,335,951,594.39	8.41%	1,242,358.60	8.54%	-
广发证券	2	11,019,171,615.95	6.42%	928,773.65	6.38%	-
民生证券	1	792,324,994.46	4.99%	728,896.10	5.01%	-
兴业证券	1	680,959,219.55	4.29%	620,559.67	4.27%	-
东吴证券	1	653,069,347.32	4.11%	595,143.91	4.09%	-
中信建投	2	490,438,062.19	3.09%	451,475.64	3.10%	-
广州证券	1	466,182,512.71	2.94%	434,154.72	2.98%	-
第一创业	1	341,103,605.51	2.15%	317,670.06	2.18%	-
中银国际	1	289,261,055.69	1.82%	269,387.73	1.85%	-
国信证券	1	209,651,092.86	1.32%	195,248.72	1.34%	-
中投证券	1	98,728,827.42	0.62%	91,010.27	0.63%	-
华泰证券	2	46,067,327.08	0.29%	41,980.46	0.29%	-
华创证券	1	11,332,435,506.02	8.39%	1,214,253.18	8.35%	-

中信金通	1	-	-	-	-	-
西北证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

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专用交易席位的选择标准和程序：

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席位：

- (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。

11.7.2 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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	363,000,000.00	54.75%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	200,000,000.00	30.17%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	100,000,000.00	15.08%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
西北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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邮储银行个人网上银行和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12月30日
2	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年12月30日
3	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行开放式公募基金交易优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年12月30日
4	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续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12月22日
5	南方基金关于旗下部分基金增加基煜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12月16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12月13日
7	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12月8日
8	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续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11月29日
9	南方基金关于旗下部分基金增加弘业期货为代销机构及开通相关	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年11月16日

	业务的公告		
10	南方基金关于旗下部分基金增加首创证券为代销机构及开通相关业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年11月9日
11	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公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年9月27日
12	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年9月26日
13	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续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9月20日
14	南方基金关于旗下部分基金增加云湾投资为代销机构及开通相关业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年9月9日
15	南方基金关于旗下部分基金增加蛋卷基金为代销机构及开通相关业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年8月19日
16	南方基金关于旗下部分基金增加广源达信为代销机构及开通相关业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年7月28日
17	南方基金关于旗下部分基金增加大智慧财富为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年7月26日
18	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7月25日
19	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7月4日

20	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7月1日
21	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
22	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
23	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
24	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
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5月19日
26	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14日
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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

32	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 29 日
33	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
34	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
35	南方高增长混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
36	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
37	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
38	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
39	关于南方基金管理有限公司旗下部分基金净值揭示异常的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
40	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
41	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
42	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日

	的公告		
--	-----	--	--

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方高增长混合型证券投资基金的文件。
- 2、南方高增长混合型证券投资基金基金合同。
- 3、南方高增长混合型证券投资基金托管协议。
- 4、南方高增长混合型证券投资基金 2016 年报报告原文。
- 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。

12.2 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

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>