

南方优选成长混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方优选成长混合型证券投资基金
基金简称	南方优选成长混合
基金主代码	202023
前端交易代码	202023
后端交易代码	202024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 30 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	211,948,577.11 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方成长”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选高成长性的优质企业进行重点投资，并通过动态的资产配置，增加组合的超额收益，在有效控制市场风险的前提下，力争为投资者寻求长期稳定的资产增值。
投资策略	本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析，结合经济周期投资时钟理论，形成对不同市场周期的预测和判断，进行积极、灵活的资产配置，确定组合中股票、

	<p>债券、现金等资产之间的投资比例。</p> <p>本基金为混合型基金，通过积极分析判断市场趋势，运用战略资产配置策略和风险管理策略，系统化管理各大类资产的配置比例。本基金严谨衡量不同类别资产的预期风险/收益特征，评估股票市场价值，如股票市场价值的整体估值水平偏离企业实际的盈利状况和预期的成长率或预计将出现较大的偏离，本基金将及时降低股票资产配置，或适度增加债券市场的配置权重，避免或减少可能给投资人带来潜在的资本损失。</p>
业绩比较基准	<p>本基金为混合型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用了上证国债指数。因此，本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式：$60\% \times \text{沪深 300 指数} + 40\% \times \text{上证国债指数}$。</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。</p>

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张海波	王洪章

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、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六

		号免税商务大厦 31-33 层
--	--	-----------------

§ 3 主要财务指标、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	9,991,430.20	414,688,380.43	327,208,378.93
本期利润	-15,635,693.79	382,376,215.11	248,003,579.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0708	1.0501	0.2601
本期加权平均净值利润率	-3.69%	59.53%	23.72%
本期基金份额净值增长率	-3.71%	49.96%	29.64%
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	200,335,967.43	204,840,670.20	222,102,347.52
期末可供分配基金份额利润	0.9452	1.0203	0.3475
期末基金资产净值	412,284,544.54	405,604,946.69	861,265,480.24
期末基金份额净值	1.945	2.020	1.347
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	94.50%	102.00%	34.70%

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

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

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

3.2 基金净值表现

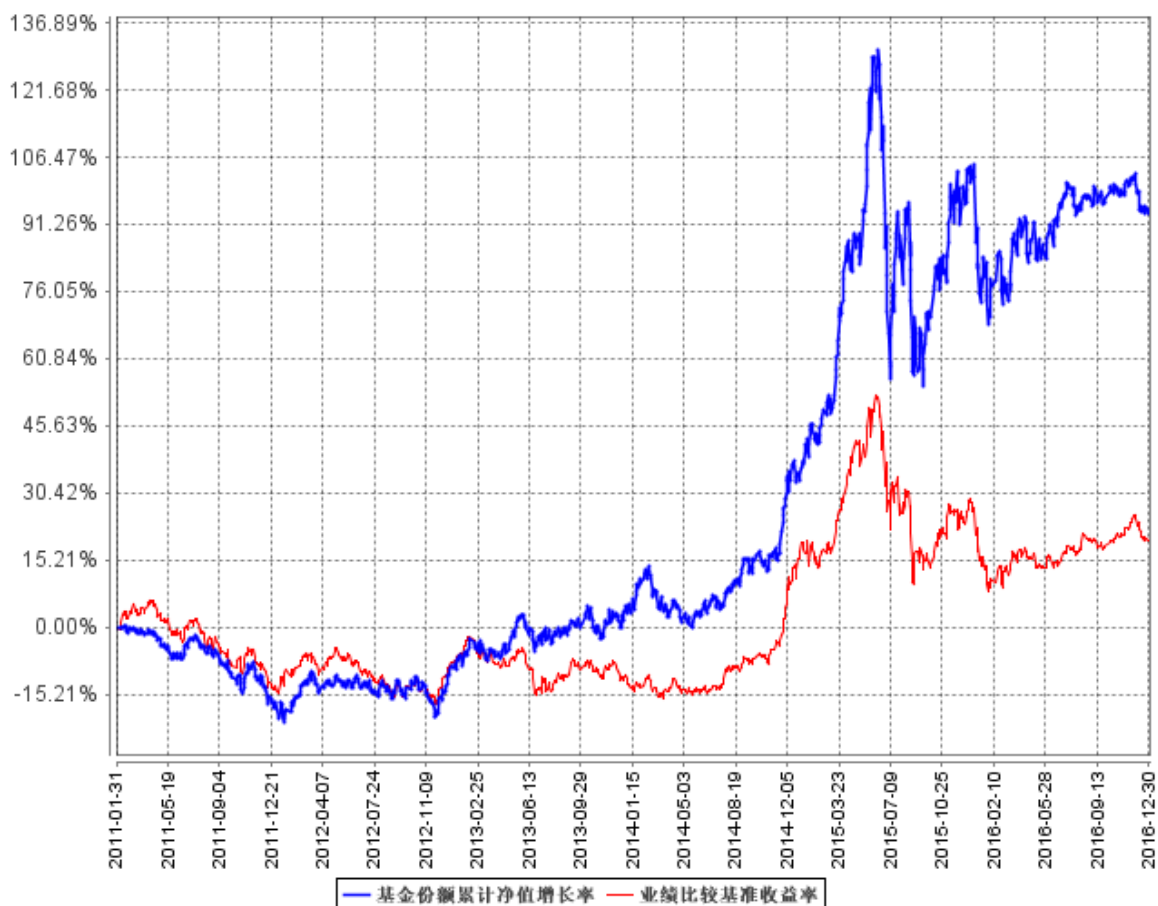
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.32%	0.51%	1.09%	0.43%	-2.41%	0.08%
过去六个月	-0.56%	0.52%	3.58%	0.46%	-4.14%	0.06%
过去一年	-3.71%	1.14%	-5.13%	0.84%	1.42%	0.30%
过去三年	87.20%	1.45%	34.10%	1.07%	53.10%	0.38%
过去五年	134.06%	1.27%	38.24%	0.97%	95.82%	0.30%
自基金合同生效起至今	94.50%	1.20%	19.76%	0.95%	74.74%	0.25%

注：本基金的业绩比较基准为 60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数。

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

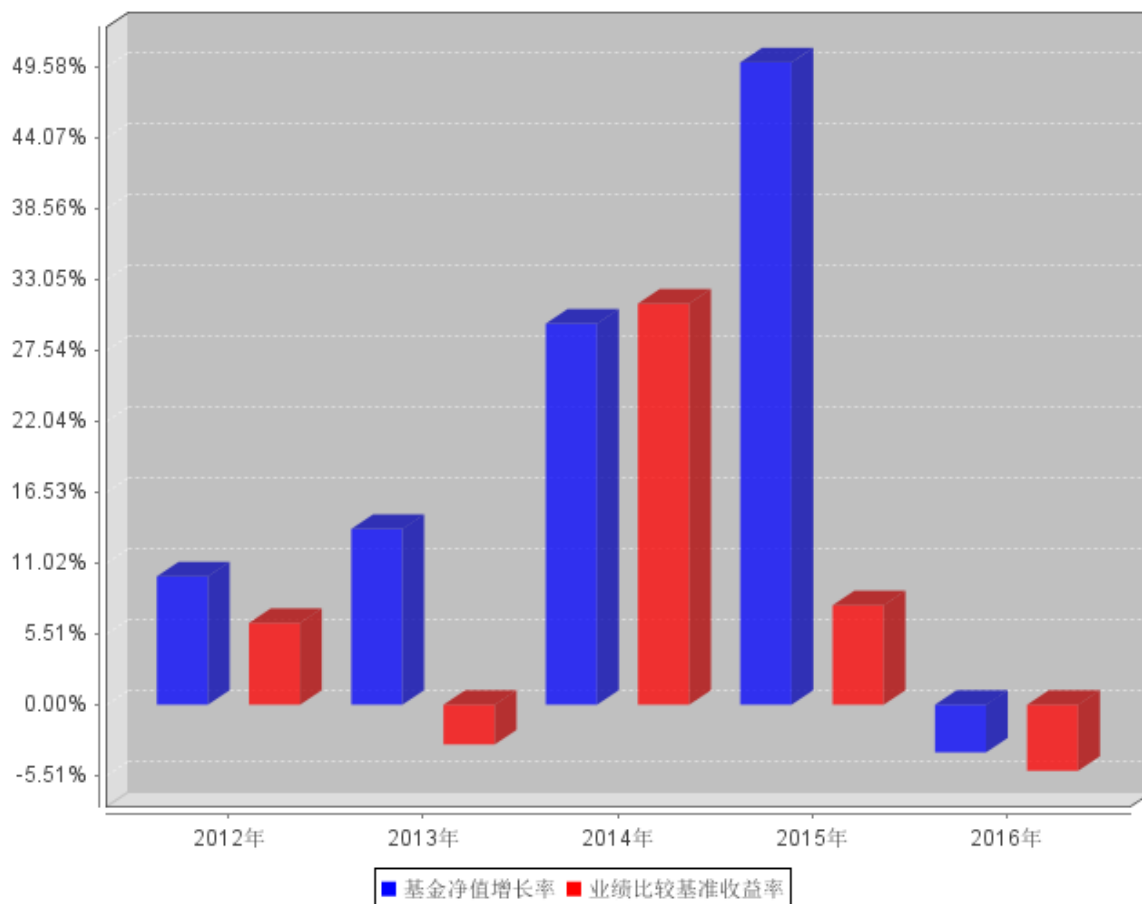
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同中关于基金投资比例的约定：股票资产占基金资产的30%~80%；债券、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为20%—70%。本基金的建仓期为2011年1月30日至2011年7月29日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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：2011 年按基金合同生效当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§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 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		
骆帅	本基金基金经理	2015 年 6 月 19 日	-	7 年	清华大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格，2009 年 7 月加入南方基金，担任研究部研究员、高级研究员；2014 年 3 月至 2015 年 5 月，任南方成份、南方安心基金经理助理；2015 年 5 月至今，任南方高端装备基金经理；2015 年 6 月至今，任南方价值、南方成长基金经理；2016 年 12 月至今，任南方绩优基金经理。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，大宗商品价格自年初以后普遍大幅上涨，带动 PPI 一路上扬；国内宏观经济在房地产投资和汽车销量的带动下企稳回升，自三季度以后制造业持续回暖，制造业 PMI 保持在枯荣线以上，工业企业利润持续改善。国际上，黑天鹅事件不断，英国脱欧、特朗普当选美国总统等事件均与市场预期偏离较大，但市场在短暂波动后仍以上升为主，尤其是特朗普上台后，市场情绪明显变得更为激进，显示了对于新一届美国政府减税改革、增大基建力度的预期。各方对于全球经济增长的展望变得更为乐观。

市场方面，A 股在年初熔断之后进入了震荡格局，内部分化较大。行业上，上游资源品在大宗商品的带动下表现较好，传媒、计算机板块表现最差；风格上，白马蓝筹持续表现良好，以创业板为代表的高估值中小股票表现较差。

大类资产配置方面，南方优选成长在年初的下跌中保持了较低仓位，获取了一定超额收益，在一季度之后的大部分时间股票仓位相对稳定，并在年末将仓位提高到了较高水平，原因在于，这个位置上很多股票的估值已经被低估，可以积极乐观一些。债券仓位一直在 20% 左右的水平。行业配置上除了长期持有的调味品、家电等消费类行业之外，增大了对于化工业和机械制造业的配置，因为从经济周期来看，在 2016 年上游大宗商品大涨之后，中游制造业有望在 2017 年取得超额收益。

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 1.945 元，本报告期份额净值增长率为-3.71%，同期业绩比较基准增长率为-5.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们正站在两个重要周期的重要转折上，一个是企业投资、设备更新周期，也叫“朱格拉周期”，另一个是从去年三季度开始的新一轮库存周期，一般持续 3 年。我们的“供给侧改革”，实际上正是朱格拉周期的一个环节——企业在利润丰厚的时候扩建产能，直到产能过剩，供过于求，利润下降；这时需要淘汰一批产能，甚至是倒闭一批企业，才能换来供需再平衡，利润回升。我们看到 2016 年出现的钢铁煤炭企业利润回升，正是这种再平衡的结果。去年是上游的利润复苏，今年自然传导到了中游，所以我们在配置上着重于中游制造，包括机械设备、精细化工等行业。这些传统行业的高速增长期已经过去，但竞争格局改善带来的龙头企业利润增长期才刚刚开始。而传媒、计算机等领域，由于过去几年景气非常好，巨大的财富效应吸引了大量的资金涌入，导致竞争激烈，而且估值偏高，我们在配置上暂时回避，等待更理想的位置。

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，积极组织了多项法律法规、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：本基金的每份基金份额享有同等分配权；、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 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 个月则可不进行收益分配；本基金收益分配方式分为两种：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按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后每一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；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，本报告期本基金未有收益分配事项。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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 21482 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	南方优选成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优选成长混合型证券投资基金(以下简称“南方优选成长混合基金”)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	编制和公允列报财务报表是南方优选成长混合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： (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； (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。
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，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述南方优选成长混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了南方优选成长混合基金 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。
注册会计师的姓名	薛竞 陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方优选成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	12,969,889.41	67,438,865.27
结算备付金		13,254,677.39	14,623,856.16
存出保证金		288,948.99	513,179.64
交易性金融资产	7.4.7.2	385,242,249.52	332,161,547.07
其中：股票投资		300,313,196.42	237,863,684.17
基金投资		-	-
债券投资		84,929,053.10	94,297,862.90
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		3,092,970.48	4,796,923.46
应收利息	7.4.7.5	1,120,436.89	1,158,575.46
应收股利		-	-
应收申购款		63,045.70	145,207.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		416,032,218.38	420,838,154.40
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		-	12,121,239.47
应付赎回款		466,223.22	502,516.80
应付管理人报酬		597,049.12	518,547.45
应付托管费		99,508.18	86,424.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,228,502.39	1,837,043.17
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	356,390.93	167,436.22
负债合计		3,747,673.84	15,233,207.71
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	211,948,577.11	200,764,276.49
未分配利润	7.4.7.10	200,335,967.43	204,840,670.20
所有者权益合计		412,284,544.54	405,604,946.69
负债和所有者权益总计		416,032,218.38	420,838,154.40

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.945 元，基金份额总额 211,948,577.11 份。

7.2 利润表

会计主体：南方优选成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 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
-----	-----	---------------------------------	--------------------------------------

一、收入		-690,827.88	403,266,201.25
1. 利息收入		4,412,193.96	6,036,039.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	778,386.40	614,977.04
债券利息收入		3,543,141.03	5,421,010.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		90,666.53	51.11
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,354,465.41	428,515,024.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,755,764.64	421,135,648.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-143,925.75	2,233,895.32
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	2,141,820.00
股利收益	7.4.7.14	742,626.52	3,003,660.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-25,627,123.99	-32,312,165.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	169,636.74	1,027,303.12
减：二、费用		14,944,865.91	20,889,986.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,360,498.23	9,643,006.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,060,083.05	1,607,167.66
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.17	7,117,013.28	9,226,304.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.18	407,271.35	413,507.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,635,693.79	382,376,215.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,635,693.79	382,376,215.11

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方优选成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）	200,764,276.49	204,840,670.20	405,604,946.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,635,693.79	-15,635,693.79
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）	11,184,300.62	11,130,991.02	22,315,291.64
其中：1. 基金申购款	101,241,611.72	95,263,785.51	196,505,397.23
2. 基金赎回款	-90,057,311.10	-84,132,794.49	-174,190,105.59
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）	211,948,577.11	200,335,967.43	412,284,544.54
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）	639,163,132.72	222,102,347.52	861,265,480.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	382,376,215.11	382,376,215.11
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）	-438,398,856.23	-399,637,892.43	-838,036,748.66
其中：1. 基金申购款	256,993,468.18	163,293,218.97	420,286,687.15
2. 基金赎回款	-695,392,324.41	-562,931,111.40	-1,258,323,435.81
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）	200,764,276.49	204,840,670.20	405,604,946.69

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

南方优选成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 1754 号《关于核准南方优选成长混合型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《南方优选成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,216,633,494.07 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 046 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方优选成长混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,216,873,965.77 份,其中认购资金利息折合 240,471.70 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方优选成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市各类股票、债券、短期金融工具、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 30%-80%,其中投资于高成长性企业的资产不低于股票资产的 80%;债券、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 20%-70%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 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》、《南方优选成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、债券投资和衍生工具(主要为股指期货)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和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(主要为股指期货)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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

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

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 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.7.1 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。

7.4.7.2 资产负债表日后事项

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。

7.4.8 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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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：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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 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	241,091,693.02	5.08%	265,300,204.58	4.51%
兴业证券	654,421,756.08	13.78%	837,543,988.73	14.25%

7.4.9.1.2 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。

7.4.9.1.3 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	224,527.64	5.16%	224,527.64	10.08%
兴业证券	596,375.81	13.70%	596,375.81	26.77%
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	241,503.41	4.55%	-	-
兴业证券	751,861.97	14.16%	110,255.51	6.00%

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

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

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 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	6,360,498.23	9,643,006.27
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,813,058.95	2,217,868.05

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 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	1,060,083.05	1,607,167.66

注：支付基金托管人 中国建设银行 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。

7.4.9.3 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。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：无。

7.4.9.4.2 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：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。

7.4.9.5 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
中国建设银行	12,969,889.41	649,340.44	67,438,865.27	491,847.43

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.9.6 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。

7.4.9.7 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。

7.4.10 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.11 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.11.1 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										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
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	2016年	2017年	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-

	新材	12月26日	1月3日	上市						
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	-
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。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.11.2 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
000887	中鼎股份	2016年11月18日	重大资产重组	25.94	2017年02月15日	23.99	294,200	7,032,215.64	7,631,548.00	-
002462	嘉事堂	2016年9月28日	重大资产重组	42.53	2017年1月12日	38.98	115,900	4,354,716.00	4,929,227.00	-
000711	京蓝科技	2016年10月19日	重大资产重组	32.54	2017年03月13日	29.29	99,988	2,802,314.08	3,253,609.52	-

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。

7.4.11.3 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。

§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	300,313,196.42	72.19
	其中：股票	300,313,196.42	72.19
2	固定收益投资	84,929,053.10	20.41
	其中：债券	84,929,053.10	20.41
	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	26,224,566.80	6.30
7	其他各项资产	4,565,402.06	1.10
8	合计	416,032,218.38	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	255,775,397.52	62.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	8,435,589.72	2.05
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	27,543,548.75	6.68
J	金融业	5,280,000.00	1.28
K	房地产业	3,253,609.52	0.79
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	300,313,196.42	72.84

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

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	000651	格力电器	800,000	19,696,000.00	4.78
2	600872	中炬高新	1,249,970	17,599,577.60	4.27
3	002043	兔宝宝	1,299,333	15,033,282.81	3.65
4	600305	恒顺醋业	999,956	11,679,486.08	2.83
5	000997	新大陆	600,000	11,658,000.00	2.83
6	002705	新宝股份	598,800	10,125,708.00	2.46
7	600426	华鲁恒升	763,700	10,119,025.00	2.45
8	002564	天沃科技	1,000,000	10,000,000.00	2.43
9	600660	福耀玻璃	500,000	9,315,000.00	2.26
10	002376	新北洋	700,000	8,680,000.00	2.11
11	000333	美的集团	300,000	8,451,000.00	2.05
12	002439	启明星辰	399,945	8,314,856.55	2.02
13	000887	中鼎股份	294,200	7,631,548.00	1.85
14	000910	大亚圣象	394,020	7,525,782.00	1.83
15	000100	TCL集团	2,229,911	7,358,706.30	1.78
16	002179	中航光电	199,905	7,254,552.45	1.76
17	601233	桐昆股份	400,000	5,744,000.00	1.39
18	000725	京东方A	2,000,000	5,720,000.00	1.39
19	002385	大北农	800,000	5,680,000.00	1.38
20	000423	东阿阿胶	100,000	5,387,000.00	1.31
21	000820	金城股份	184,400	5,329,160.00	1.29
22	600036	招商银行	300,000	5,280,000.00	1.28
23	002258	利尔化学	400,000	4,972,000.00	1.21
24	002462	嘉事堂	115,900	4,929,227.00	1.20
25	600409	三友化工	500,000	4,695,000.00	1.14
26	600104	上汽集团	200,000	4,690,000.00	1.14
27	600664	哈药股份	500,000	4,290,000.00	1.04

28	600195	中牧股份	199,967	4,249,298.75	1.03
29	000915	山大华特	100,000	4,213,000.00	1.02
30	002108	沧州明珠	200,000	4,074,000.00	0.99
31	002353	杰瑞股份	199,909	4,058,152.70	0.98
32	600718	东软集团	200,000	3,932,000.00	0.95
33	002053	云南能投	200,000	3,838,000.00	0.93
34	603989	艾华集团	100,000	3,681,000.00	0.89
35	002648	卫星石化	300,000	3,666,000.00	0.89
36	002007	华兰生物	100,000	3,575,000.00	0.87
37	603108	润达医疗	114,737	3,506,362.72	0.85
38	300369	绿盟科技	100,000	3,397,000.00	0.82
39	000902	新洋丰	300,000	3,378,000.00	0.82
40	000711	京蓝科技	99,988	3,253,609.52	0.79
41	002523	天桥起重	469,700	3,146,990.00	0.76
42	002372	伟星新材	200,000	3,086,000.00	0.75
43	002563	森马服饰	300,000	3,081,000.00	0.75
44	002600	江粉磁材	300,000	3,072,000.00	0.75
45	002468	艾迪西	100,000	3,022,000.00	0.73
46	002094	青岛金王	100,000	3,000,000.00	0.73
47	000860	顺鑫农业	100,000	2,200,000.00	0.53
48	600362	江西铜业	100,000	1,673,000.00	0.41
49	603699	纽威股份	85,400	1,438,136.00	0.35
50	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.06
51	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.02
52	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.02
53	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
54	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.01
55	603239	N 仙通	924	29,059.80	0.01
56	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
57	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
58	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.00
59	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
60	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
61	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
62	300586	美联新材	1,006	9,355.80	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	002043	兔宝宝	39,392,957.14	9.71
2	600872	中炬高新	27,798,275.10	6.85
3	000651	格力电器	24,896,737.00	6.14
4	000910	大亚圣象	24,645,268.89	6.08
5	300302	同有科技	23,795,200.97	5.87
6	002137	麦达数字	23,635,680.42	5.83
7	000333	美的集团	20,812,425.93	5.13
8	002301	齐心集团	20,466,455.57	5.05
9	002688	金河生物	19,021,977.42	4.69
10	002142	宁波银行	19,013,710.07	4.69
11	600109	国金证券	18,656,124.62	4.60
12	002466	天齐锂业	17,240,035.10	4.25
13	600426	华鲁恒升	16,780,043.48	4.14
14	600104	上汽集团	16,459,371.00	4.06
15	600597	光明乳业	16,451,406.27	4.06
16	600887	伊利股份	16,174,226.97	3.99
17	300068	南都电源	16,058,358.51	3.96
18	600036	招商银行	15,776,401.98	3.89
19	603108	润达医疗	15,607,958.42	3.85
20	002643	万润股份	15,410,600.73	3.80
21	002705	新宝股份	14,756,051.99	3.64
22	000915	山大华特	14,704,594.51	3.63
23	600602	云赛智联	14,672,470.41	3.62
24	300230	永利股份	14,359,125.00	3.54
25	300303	聚飞光电	14,344,940.90	3.54
26	300014	亿纬锂能	13,826,949.60	3.41
27	002376	新北洋	13,686,019.00	3.37
28	002179	中航光电	13,666,642.45	3.37
29	002511	中顺洁柔	13,484,200.72	3.32
30	000338	潍柴动力	13,228,727.53	3.26
31	002597	金禾实业	12,786,972.53	3.15

32	600978	宜华生活	12,687,269.29	3.13
33	600055	万东医疗	12,623,838.00	3.11
34	000625	长安汽车	12,356,748.04	3.05
35	002570	贝因美	12,322,150.11	3.04
36	600547	山东黄金	12,112,739.00	2.99
37	300113	顺网科技	11,955,097.00	2.95
38	600305	恒顺醋业	11,854,239.72	2.92
39	002353	杰瑞股份	11,714,436.49	2.89
40	000606	*ST 易桥	11,598,747.50	2.86
41	000997	新大陆	11,552,598.91	2.85
42	300106	西部牧业	11,482,845.35	2.83
43	000818	方大化工	11,400,952.20	2.81
44	300365	恒华科技	11,073,499.15	2.73
45	600276	恒瑞医药	10,952,540.69	2.70
46	600718	东软集团	10,860,379.41	2.68
47	000887	中鼎股份	10,830,370.64	2.67
48	000421	南京公用	10,797,803.92	2.66
49	600452	涪陵电力	10,462,309.85	2.58
50	000662	天夏智慧	10,355,228.51	2.55
51	600655	豫园商城	10,322,955.34	2.55
52	300219	鸿利智汇	10,272,193.65	2.53
53	002564	天沃科技	10,190,615.22	2.51
54	002364	中恒电气	9,833,955.04	2.42
55	603609	禾丰牧业	9,593,900.57	2.37
56	300109	新开源	9,559,994.00	2.36
57	002615	哈尔斯	9,530,911.00	2.35
58	002609	捷顺科技	9,451,953.39	2.33
59	000630	铜陵有色	9,380,732.00	2.31
60	000568	泸州老窖	9,324,448.28	2.30
61	002185	华天科技	9,238,230.88	2.28
62	300271	华宇软件	9,185,010.84	2.26
63	300231	银信科技	9,167,924.40	2.26
64	600566	济川药业	9,102,207.12	2.24
65	300009	安科生物	9,099,864.58	2.24
66	600576	万家文化	9,043,099.30	2.23
67	600660	福耀玻璃	9,009,566.44	2.22

68	600418	江淮汽车	8,981,518.76	2.21
69	300007	汉威电子	8,914,151.97	2.20
70	002439	启明星辰	8,746,989.54	2.16
71	002539	云图控股	8,730,414.50	2.15
72	300144	宋城演艺	8,701,925.97	2.15
73	600195	中牧股份	8,647,852.01	2.13
74	002284	亚太股份	8,576,325.00	2.11
75	603020	爱普股份	8,421,425.00	2.08
76	002120	新海股份	8,300,521.00	2.05
77	002152	广电运通	8,266,603.72	2.04
78	603808	歌力思	8,233,117.30	2.03
79	600079	人福医药	8,224,325.14	2.03
80	300369	绿盟科技	8,177,253.60	2.02
81	600801	华新水泥	8,112,700.30	2.00

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	002137	麦达数字	33,758,772.37	8.32
2	300302	同有科技	31,533,049.48	7.77
3	002043	兔宝宝	22,983,683.64	5.67
4	000910	大亚圣象	22,407,875.50	5.52
5	002643	万润股份	20,708,872.50	5.11
6	300068	南都电源	19,282,863.86	4.75
7	600576	万家文化	19,240,209.62	4.74
8	300100	双林股份	18,960,812.93	4.67
9	002301	齐心集团	18,949,057.99	4.67
10	002142	宁波银行	18,890,047.90	4.66
11	002407	多氟多	18,527,812.92	4.57
12	300113	顺网科技	17,893,311.55	4.41
13	600597	光明乳业	17,681,498.27	4.36
14	002466	天齐锂业	17,610,254.52	4.34
15	002688	金河生物	17,550,563.27	4.33
16	600109	国金证券	17,375,571.39	4.28

17	002511	中顺洁柔	16,908,682.21	4.17
18	600887	伊利股份	16,240,112.13	4.00
19	002508	老板电器	15,833,765.32	3.90
20	300014	亿纬锂能	15,779,478.61	3.89
21	002597	金禾实业	15,513,691.29	3.82
22	300303	聚飞光电	14,953,289.54	3.69
23	000338	潍柴动力	14,890,244.59	3.67
24	600602	云赛智联	14,707,478.68	3.63
25	300368	汇金股份	14,248,713.44	3.51
26	000625	长安汽车	13,485,197.66	3.32
27	300271	华宇软件	13,436,239.72	3.31
28	300230	永利股份	13,229,613.61	3.26
29	000333	美的集团	13,147,248.93	3.24
30	600055	万东医疗	12,486,334.70	3.08
31	002394	联发股份	12,280,937.39	3.03
32	600104	上汽集团	12,124,961.39	2.99
33	603108	润达医疗	12,043,282.70	2.97
34	600978	宜华生活	11,941,640.92	2.94
35	600547	山东黄金	11,861,897.00	2.92
36	002570	贝因美	11,626,027.17	2.87
37	000818	方大化工	11,553,407.91	2.85
38	300365	恒华科技	11,551,438.54	2.85
39	000421	南京公用	11,471,618.46	2.83
40	300219	鸿利智汇	11,381,549.24	2.81
41	600655	豫园商城	11,345,266.94	2.80
42	600276	恒瑞医药	10,811,872.96	2.67
43	000915	山大华特	10,754,367.82	2.65
44	002364	中恒电气	10,726,430.33	2.64
45	002609	捷顺科技	10,630,126.87	2.62
46	300106	西部牧业	10,611,565.08	2.62
47	002615	哈尔斯	10,428,148.54	2.57
48	600036	招商银行	10,277,220.84	2.53
49	000662	天夏智慧	10,181,083.50	2.51
50	600452	涪陵电力	10,069,963.22	2.48
51	002120	新海股份	10,037,722.93	2.47
52	000630	铜陵有色	9,855,142.89	2.43
53	300007	汉威电子	9,852,489.23	2.43
54	600418	江淮汽车	9,819,723.35	2.42

55	600566	济川药业	9,681,789.50	2.39
56	000568	泸州老窖	9,624,640.90	2.37
57	603609	禾丰牧业	9,357,481.90	2.31
58	300009	安科生物	9,072,158.79	2.24
59	002284	亚太股份	9,044,317.74	2.23
60	002185	华天科技	8,819,724.60	2.17
61	600779	水井坊	8,690,086.89	2.14
62	300166	东方国信	8,679,018.00	2.14
63	300232	洲明科技	8,619,415.00	2.13
64	000802	北京文化	8,617,418.88	2.12
65	600589	广东榕泰	8,617,237.93	2.12
66	002041	登海种业	8,527,129.62	2.10
67	300144	宋城演艺	8,493,832.77	2.09
68	002078	太阳纸业	8,485,744.27	2.09
69	300231	银信科技	8,403,552.00	2.07
70	000065	北方国际	8,385,839.00	2.07
71	603020	爱普股份	8,348,621.50	2.06
72	002048	宁波华翔	8,301,040.31	2.05
73	600872	中炬高新	8,160,946.27	2.01
74	600210	紫江企业	8,129,439.00	2.00

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	2,408,378,991.27
卖出股票收入（成交）总额	2,341,647,824.22

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

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	79,546,000.00	19.29
	其中：政策性金融债	79,546,000.00	19.29
4	企业债券	5,383,053.10	1.31

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	84,929,053.10	20.60

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	140225	14 国开 25	400,000	40,308,000.00	9.78
2	160311	16 进出 11	200,000	19,834,000.00	4.81
3	160207	16 国开 07	200,000	19,404,000.00	4.71
4	122151	12 国电 01	48,100	4,832,607.00	1.17
5	120301	03 沪轨道	5,470	550,446.10	0.13

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：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	288,948.99
2	应收证券清算款	3,092,970.48
3	应收股利	-
4	应收利息	1,120,436.89
5	应收申购款	63,045.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,565,402.06

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
18,818	11,263.08	16,182,862.25	7.64%	195,765,714.86	92.36%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	779,539.76	0.3678%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月30日）基金份额总额	2,216,873,965.77
本报告期期初基金份额总额	200,764,276.49

本报告期基金总申购份额	101,241,611.72
减:本报告期基金总赎回份额	90,057,311.10
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	211,948,577.11

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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。

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。

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 55,000.00 元。

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	
民族证券	1	1,338,457,132.78	28.18%	1,219,740.37	28.02%	-
招商证券	1	719,931,517.39	15.16%	656,075.19	15.07%	-
兴业证券	1	654,421,756.08	13.78%	596,375.81	13.70%	-
中金公司	1	616,217,641.66	12.98%	561,559.71	12.90%	-
安信证券	1	453,391,791.08	9.55%	422,245.33	9.70%	-
中泰证券	1	332,083,577.79	6.99%	309,268.63	7.10%	-
华泰证券	1	241,091,693.02	5.08%	224,527.64	5.16%	-
国泰君安	1	167,030,067.95	3.52%	152,215.49	3.50%	-
第一创业	1	131,750,880.17	2.77%	122,699.57	2.82%	-
银河证券	1	94,654,401.82	1.99%	88,150.76	2.03%	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源, 我公司在交易所交易系统升级的基础上, 对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、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单元的选择标准和程序。

A：选择标准

(a) 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

(b) 公司具有较强的研究能力, 能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；

(c) 公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

(d) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程

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

(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
民族证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	110,000,000.00	17.46%	-	-
中泰证券	-	-	290,000,000.00	46.03%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	110,000,000.00	17.46%	-	-
银河证券	-	-	120,000,000.00	19.05%	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序

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

A：选择标准

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

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

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