

南方量化成长股票型证券投资基金 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 2016 年 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.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	75
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.....	75
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.....	75

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.....	75
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.....	75
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
8.12 投资组合报告附注.....	76
§9 基金份额持有人信息.....	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
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.....	78
§10 开放式基金份额变动.....	79
§11 重大事件揭示.....	80
11.1 基金份额持有人大会决议.....	80
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.....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
11.4 基金投资策略的改变.....	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
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.....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
11.8 其他重大事件.....	83
§12 备查文件目录.....	90
12.1 备查文件目录.....	90
12.2 存放地点.....	90
12.3 查阅方式.....	90

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方量化成长股票型证券投资基金
基金简称	南方量化成长股票
基金主代码	001421
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 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	995,073,246.96 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“南方量化成长”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金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股票、债券等各类资产的比例，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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
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、基金托管人的住所

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	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 6 月 29 日(基金合同生效日)- 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	47,414,338.79	50,245,429.01
本期利润	-3,686,799.29	69,775,524.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0109	0.1744
本期加权平均净值利润率	-0.89%	17.40%
本期基金份额净值增长率	5.77%	23.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	299,553,107.38	41,968,311.67
期末可供分配基金份额利润	0.3010	0.2089
期末基金资产净值	1,294,626,354.34	247,094,411.62
期末基金份额净值	1.301	1.230
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	30.10%	23.00%

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

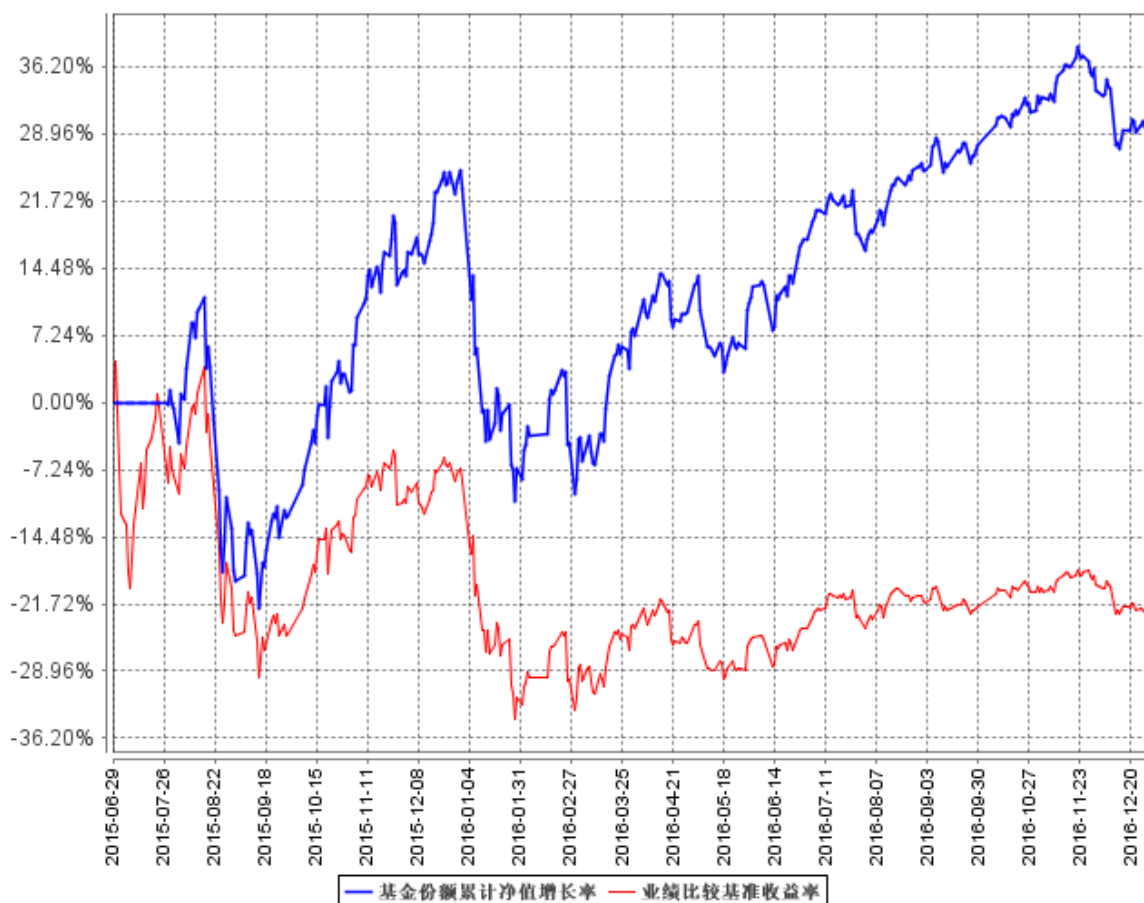
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.80%	0.86%	-0.90%	0.74%	2.70%	0.12%
过去六个月	10.63%	0.87%	2.24%	0.83%	8.39%	0.04%
过去一年	5.77%	1.78%	-15.52%	1.71%	21.29%	0.07%
自基金合同生效起至今	30.10%	2.06%	-27.16%	2.22%	57.26%	-0.16%

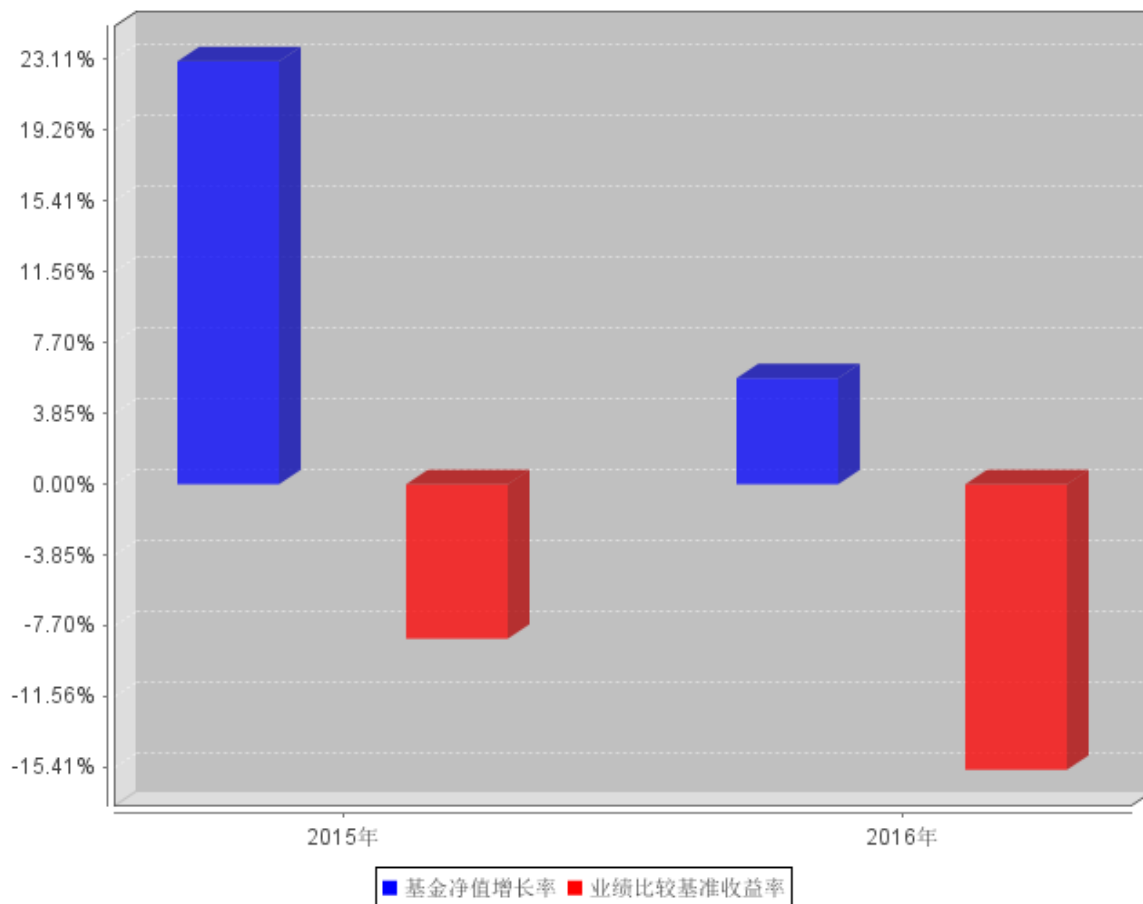
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：过往三年本基金未有利润分配事项。

§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		
雷俊	本基金基金经理	2015年6月29日	-	8年	北京大学智能科学系硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员，现任数量化投资部总监助理；2014年12月至2016年4月，任南方恒生ETF基金经理；2015年4月至2016年4月，任南方中证500工业ETF、南方中证500原材料ETF基金经理；2015年6月至2016年7月，任改革基金、高铁基金、南方500信息基金经理；2015年4月至今，任大数据100基金经理；2015年6月至今，任南方策略优化、大数据300、南方量化成长的基金

						经理。
--	--	--	--	--	--	-----

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《南方量化成长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

四季度 A 股略有回升，整体上看是先涨后跌，下跌时大盘略优于小盘股，市场总体仍在一个较窄的区间内震荡。

报告期内，本基金选股策略以量化多因子模型选股为主，充分借助南方大数据量化平台的研究成果，有效整合了传统多因子研究的模型和大数据模型，根据融合模型进行股票投资；另外，实际结合期货的升贴水情况和基金的流动性要求，也有参与部分期货投资。

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 1.301 元；报告期内，基金份额净值增长率为 5.77%，同期业绩基准增长率为-15.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观上看，国内经济阶段企稳、通胀压力有所回升，货币政策将更加中性，无风险利率的回升将对冲掉部分企业盈利改善的利好，人民币汇率转强又有助于修复风险偏好，对冲险资举牌监管的影响；从估值、盈利和跨境比较角度看，权益类资产经历三轮大幅下跌后，投资性价比已经大幅提高，部分板块和个股的投资价值凸显。增量资金依然可期，只是以低风险偏好的机构资金为主，入市节奏较为缓慢；综合以上，权益市场的慢牛表现逻辑逐渐加强。

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、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 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，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。

4.9 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”）在南方量化成长股票型证券投资基金（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 21417 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	南方量化成长股票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量化成长股票型证券投资基金(以下简称“南方量化成长基金”)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量化成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</p>

	<p>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	<p>我们认为，上述南方量化成长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，公允反映了南方量化成长基金 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。</p>
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：南方量化成长股票型证券投资基金

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	38,973,221.24	25,341,735.28
结算备付金		192,683,499.84	10,253,190.65
存出保证金		23,102,590.24	4,087,785.84
交易性金融资产	7.4.7.2	1,053,139,871.91	209,892,335.07
其中：股票投资		1,053,139,871.91	209,892,335.07
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	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	26,947.85	10,811.07
应收股利		-	-
应收申购款		7,861,232.26	735,302.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,315,787,363.34	250,321,160.58
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		11,375,227.68	-
应付赎回款		4,817,906.47	1,407,149.80
应付管理人报酬		1,584,422.46	338,226.19
应付托管费		264,070.41	56,371.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,858,303.05	1,315,137.75
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	261,078.93	109,864.18
负债合计		21,161,009.00	3,226,748.96
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	995,073,246.96	200,917,883.43
未分配利润	7.4.7.10	299,553,107.38	46,176,528.19
所有者权益合计		1,294,626,354.34	247,094,411.62
负债和所有者权益总计		1,315,787,363.34	250,321,160.58

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.301 元，基金份额总额 995,073,246.96 份。

7.2 利润表

会计主体：南方量化成长股票型证券投资基金

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 6 月 29 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		12,922,698.48	77,334,027.22
1. 利息收入		1,012,224.42	718,673.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	754,370.98	467,137.43
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		257,853.44	251,536.17
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		60,753,899.53	56,163,681.73
其中：股票投资收益	7.4.7.12	58,929,208.38	54,316,035.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	500,517.80	1,661,960.00
股利收益	7.4.7.15	1,324,173.35	185,685.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-51,101,138.08	19,530,095.20
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	2,257,712.61	921,576.69
减：二、费用		16,609,497.77	7,558,503.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,028,780.55	3,045,358.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,004,796.65	507,559.73
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	9,198,626.70	3,789,898.32
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	377,293.87	215,686.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,686,799.29	69,775,524.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,686,799.29	69,775,524.21

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方量化成长股票型证券投资基金

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）	200,917,883.43	46,176,528.19	247,094,411.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,686,799.29	-3,686,799.29
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）	794,155,363.53	257,063,378.48	1,051,218,742.01
其中：1. 基金申购款	1,206,038,856.87	362,810,127.65	1,568,848,984.52
2. 基金赎回款	-411,883,493.34	-105,746,749.17	-517,630,242.51

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）	995,073,246.96	299,553,107.38	1,294,626,354.34
项目	上年度可比期间		
	2015年6月29日(基金合同生效日)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）	481,169,673.62	-	481,169,673.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	69,775,524.21	69,775,524.21
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）	-280,251,790.19	-23,598,996.02	-303,850,786.21
其中：1. 基金申购款	31,664,363.98	4,090,781.01	35,755,144.99
2. 基金赎回款	-311,916,154.17	-27,689,777.03	-339,605,931.20
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）	200,917,883.43	46,176,528.19	247,094,411.62

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

南方量化成长股票型证券投资基金(以下简称“南方量化成长股票基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1038号《关于准予南方量化成长股票型证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方量化成长股票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人民币480,945,966.65元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第766号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方量化成长股票型证券投资基金基金合同》于2015年6月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为481,169,673.62份基金份额,其中认购资金利息折合223,706.97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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方量化成长股票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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的80%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×90%+上证国债指数收益率×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》、《南方量化成长股票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。比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

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。

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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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。

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) 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	38,973,221.24	25,341,735.28
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-

其他存款	-	-
合计:	38,973,221.24	25,341,735.28

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	1,083,460,036.99	1,053,139,871.91	-30,320,165.08
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	1,083,460,036.99	1,053,139,871.91	-30,320,165.08
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	190,264,599.87	209,892,335.07	19,627,735.20
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	190,264,599.87	209,892,335.07	19,627,735.20

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	-	-	-	
—股指期货	114,403,917.80	-	-	注：-
—指数期权	-	-	-	注：-
—股票期权	-	-	-	注：-
其他衍生工具	-	-	-	
合计	114,403,917.80	-	-	
项目	上年度末 2015年12月31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	-	-	-	
—外汇期货	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
—股指期货	19,335,040.00	-	-	注：-
—指数期权	-	-	-	注：-
—股票期权	-	-	-	注：-
其他衍生工具	-	-	-	

合计	19,335,040.00	-	-
----	---------------	---	---

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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	12,560.73	5,614.80
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	14,174.72	5,088.17
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	212.40	108.10
合计	26,947.85	10,811.07

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,858,303.05	1,315,137.75
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	2,858,303.05	1,315,137.75
----	--------------	--------------

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	6,078.93	4,864.18
预提费用	255,000.00	105,000.00
合计	261,078.93	109,864.18

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	200,917,883.43	200,917,883.43
本期申购	1,206,038,856.87	1,206,038,856.87
本期赎回（以“-”号填列）	-411,883,493.34	-411,883,493.34
本期末	995,073,246.96	995,073,246.96

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	41,968,311.67	4,208,216.52	46,176,528.19
本期利润	47,414,338.79	-51,101,138.08	-3,686,799.29
本期基金份额交易产生的变动数	296,085,948.90	-39,022,570.42	257,063,378.48
其中：基金申购款	425,726,377.72	-62,916,250.07	362,810,127.65

基金赎回款	-129,640,428.82	23,893,679.65	-105,746,749.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	385,468,599.36	-85,915,491.98	299,553,107.38

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6月29日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	301,572.91	425,909.28
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	436,310.53	39,774.85
其他	16,487.54	1,453.30
合计	754,370.98	467,137.43

7.4.7.12 股票投资收益

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6月29日(基金 合同生效日)至2015年12月 31日
卖出股票成交总额	2,758,450,396.70	1,211,317,732.39
减：卖出股票成本总额	2,699,521,188.32	1,157,001,696.53
买卖股票差价收入	58,929,208.38	54,316,035.86

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年6月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	500,517.80	1,661,960.00

7.4.7.15 股利收益

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6月29日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,324,173.35	185,685.87
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,324,173.35	185,685.87

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至 2016年12月31日	2015年6月29日(基金合 同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-49,947,900.28	19,627,735.20
——股票投资	-49,947,900.28	19,627,735.20
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-1,153,237.80	-97,640.00
——权证投资	-	-

股指期货投资	-1,153,237.80	-97,640.00
3. 其他	-	-
合计	-51,101,138.08	19,530,095.20

7.4.7.17 其他收入

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6月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
基金赎回费收入	2,166,142.05	882,259.78
转换费收入	91,570.56	39,316.91
-	-	-
合计	2,257,712.61	921,576.69

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

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6月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
交易所市场交易费用	9,198,626.70	3,789,898.32
银行间市场交易费用	-	-
合计	9,198,626.70	3,789,898.32

7.4.7.19 其他费用

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 6 月 29 日(基金合同 生效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	300,000.00	150,000.00
银行费用	22,293.87	10,286.24
其他	-	400.00
合计	377,293.87	215,686.24

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

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、注册登记机构、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6月29日(基金合同生效日)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	1,264,550,567.57	19.93%	-	-
兴业证券	616,012,484.27	9.71%	136,132,209.39	5.32%

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	1,160,542.06	19.92%	1,160,542.06	40.60%
兴业证券	561,373.62	9.63%	47,885.94	1.68%

关联方名称	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日)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
兴业证券	124,057.07	5.30%	124,057.07	9.43%

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6月29日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付 的管理费	6,028,780.55	3,045,358.72
其中：支付销售机构的 客户维护费	1,790,881.48	1,119,213.83

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。

7.4.10.2.2 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6月29日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付 的托管费	1,004,796.65	507,559.73

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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)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	38,973,221.24	301,572.91	25,341,735.28	425,909.28

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

注：本基金本报告期内无利润分配。

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 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

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 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	-

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
600892	大晟文化	2016年11月16日	重大资产重组	78.31	2017年2月21日	70.48	65,500	4,517,014.14	5,129,305.00	-
600814	杭州解百	2016年12月26日	重大事项未公告	11.37	2017年1月9日	10.70	361,000	3,749,944.54	4,104,570.00	-
000048	康达尔	2016年12月1日	重大资产重组	37.92	2017年3月1日	37.18	104,800	3,717,907.52	3,974,016.00	-
300420	五洋科技	2016年12月13日	重大资产重组	24.98	2017年3月23日	27.48	147,200	3,613,705.50	3,677,056.00	-
002724	海洋王	2016年12月29日	重大事项未公告	25.84	-	-	138,100	3,415,008.61	3,568,504.00	-
002567	唐人神	2016年12月22日	重大事项	12.64	2017年1月3日	12.75	272,800	3,413,175.20	3,448,192.00	-
600551	时代出版	2016年11月	重大资产重组	20.32	-	-	164,500	3,436,637.96	3,342,640.00	-

		28 日								
000411	英特集团	2016 年 12 月 27 日	重大事 项	22.10	2017 年 1 月 11 日	24.31	134,900	3,101,563.01	2,981,290.00	-
002652	扬子新材	2016 年 12 月 12 日	重大资 产重组	18.11	-	-	159,400	2,670,491.04	2,886,734.00	-
002659	中泰桥梁	2016 年 11 月 3 日	重大资 产重组	21.77	2017 年 1 月 6 日	19.60	74,700	1,429,020.00	1,626,219.00	-
002239	奥特佳	2016 年 10 月 18 日	重大资 产重组	15.69	2017 年 2 月 7 日	14.12	78,500	1,215,083.78	1,231,665.00	-
000560	昆百大 A	2016 年 9 月 2 日	重大资 产重组	10.40	2017 年 3 月 24 日	11.44	109,700	1,066,593.86	1,140,880.00	-
600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	重大资 产重组	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	56,000	920,897.14	919,520.00	-
600225	天津松江	2016 年 11 月 8 日	重大资 产重组	6.64	-	-	132,000	833,873.00	876,480.00	-
002579	中京电子	2016 年 12 月 5 日	重大资 产重组	13.68	2017 年 3 月 1 日	14.29	53,200	735,123.18	727,776.00	-
002798	帝王洁具	2016 年 11 月 2 日	重大资 产重组	67.00	2017 年 1 月 17 日	60.34	7,200	475,374.00	482,400.00	-

600855	航天长峰	2016 年 11 月 8 日	重大资产重组	28.89	-	-	14,500	427,491.68	418,905.00	-
002034	美欣达	2016 年 10 月 10 日	重大资产重组	36.33	2017 年 1 月 13 日	39.96	7,800	273,391.02	283,374.00	-
300480	光力科技	2016 年 10 月 10 日	重大事项未公告	22.22	2017 年 1 月 5 日	24.44	12,700	278,741.00	282,194.00	-

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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金。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，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)。

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%。本基金所持证券在证券交易所上市，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，其余均能以合理价格适时变现。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

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

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	38,973,221.24	-	-	-	38,973,221.24
结算备付金	192,683,499.84	-	-	-	192,683,499.84
存出保证金	471,982.24	-	-	22,630,608.00	23,102,590.24
交易性金融资产	-	-	-	1,053,139,871.91	1,053,139,871.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	26,947.85	26,947.85
应收申购款	3,572,493.68	-	-	4,288,738.58	7,861,232.26
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	235,701,197.00	-	-	1,080,086,166.34	1,315,787,363.34
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,375,227.68	11,375,227.68
应付赎回款	-	-	-	4,817,906.47	4,817,906.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,584,422.46	1,584,422.46
应付托管费	-	-	-	264,070.41	264,070.41
应付交易费用	-	-	-	2,858,303.05	2,858,303.05
其他负债	-	-	-	261,078.93	261,078.93
负债总计	-	-	-	21,161,009.00	21,161,009.00
利率敏感度缺口	235,701,197.00	-	-	1,058,925,157.34	1,294,626,354.34
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	25,341,735.28	-	-	-	25,341,735.28
结算备付金	10,253,190.65	-	-	-	10,253,190.65
存出保证金	240,305.84	-	-	3,847,480.00	4,087,785.84
交易性金融资产	-	-	-	209,892,335.07	209,892,335.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,811.07	10,811.07
应收申购款	135,530.10	-	-	599,772.57	735,302.67

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,970,761.87	-	-	214,350,398.71	250,321,160.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,407,149.80	1,407,149.80
应付管理人报酬	-	-	-	338,226.19	338,226.19
应付托管费	-	-	-	56,371.04	56,371.04
应付交易费用	-	-	-	1,315,137.75	1,315,137.75
其他负债	-	-	-	109,864.18	109,864.18
负债总计	-	-	-	3,226,748.96	3,226,748.96
利率敏感度缺口	35,970,761.87	-	-	211,123,649.75	247,094,411.62

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），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。本基金的投资组合中，股票投资比例为基

金资产的 80%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	1,053,139,871.91	81.35	209,892,335.07	84.94
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	1,053,139,871.91	81.35	209,892,335.07	84.94

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 5,527	增加约 811
	2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 5,527	减少约 811

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 1,011,568,757.58 元，属于第二层次的余额为 41,571,114.33 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 182,586,798.17 元，第二层次 27,305,536.90 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，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	1,053,139,871.91	80.04
	其中：股票	1,053,139,871.91	80.04
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	231,656,721.08	17.61
7	其他各项资产	30,990,770.35	2.36
8	合计	1,315,787,363.34	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	10,786,611.00	0.83
B	采矿业	2,709,210.00	0.21
C	制造业	733,846,873.32	56.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供	13,654,819.40	1.05

	应业		
E	建筑业	5,060,476.13	0.39
F	批发和零售业	65,008,881.95	5.02
G	交通运输、仓储和邮政业	26,094,374.76	2.02
H	住宿和餐饮业	3,639,447.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	109,504,267.57	8.46
J	金融业	6,920,936.70	0.53
K	房地产业	28,062,429.50	2.17
L	租赁和商务服务业	3,585,912.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	5,479,119.74	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	6,229,811.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,157,938.00	0.48
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	22,939,559.84	1.77
S	综合	3,459,204.00	0.27
	合计	1,053,139,871.91	81.35

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	300365	恒华科技	253,489	10,519,793.50	0.81
2	300112	万讯自控	515,859	7,371,625.11	0.57
3	300130	新国都	286,093	7,103,689.19	0.55
4	300277	海联讯	570,750	7,094,422.50	0.55
5	300312	邦讯技术	495,611	7,072,368.97	0.55

6	002430	杭氧股份	813,400	7,035,910.00	0.54
7	600297	广汇汽车	821,900	7,035,464.00	0.54
8	601677	明泰铝业	472,259	6,989,433.20	0.54
9	002296	辉煌科技	439,831	6,944,931.49	0.54
10	300108	双龙股份	747,700	6,916,225.00	0.53
11	603969	银龙股份	495,000	6,900,300.00	0.53
12	000546	金圆股份	597,320	6,761,662.40	0.52
13	600882	广泽股份	622,700	6,687,798.00	0.52
14	600746	江苏索普	529,400	6,643,970.00	0.51
15	600004	白云机场	468,300	6,598,347.00	0.51
16	300346	南大光电	215,200	6,550,688.00	0.51
17	600479	千金药业	413,526	6,521,305.02	0.50
18	002667	鞍重股份	229,400	6,459,904.00	0.50
19	002182	云海金属	345,500	6,429,755.00	0.50
20	300354	东华测试	263,368	6,426,179.20	0.50
21	002209	达意隆	276,787	6,418,690.53	0.50
22	300437	清水源	268,800	6,373,248.00	0.49
23	300259	新天科技	615,000	6,371,400.00	0.49
24	300395	菲利华	270,050	6,257,058.50	0.48
25	600661	新南洋	216,600	6,157,938.00	0.48
26	600373	中文传媒	304,211	6,145,062.20	0.47
27	600309	万华化学	280,260	6,033,997.80	0.47
28	300283	温州宏丰	608,247	5,972,985.54	0.46
29	000880	潍柴重机	420,000	5,884,200.00	0.45
30	601137	博威合金	441,816	5,774,535.12	0.45
31	300270	中威电子	379,206	5,760,139.14	0.44
32	300464	星徽精密	312,293	5,661,872.09	0.44
33	603885	吉祥航空	233,500	5,440,550.00	0.42

34	603011	合锻智能	456,900	5,272,626.00	0.41
35	600507	方大特钢	775,500	5,250,135.00	0.41
36	300306	远方光电	218,900	5,176,985.00	0.40
37	600892	大晟文化	65,500	5,129,305.00	0.40
38	000708	大冶特钢	360,500	4,592,770.00	0.35
39	300417	南华仪器	81,866	4,491,168.76	0.35
40	002338	奥普光电	90,200	4,365,680.00	0.34
41	600814	杭州解百	361,000	4,104,570.00	0.32
42	002300	太阳电缆	426,700	4,070,718.00	0.31
43	002094	青岛金王	134,700	4,041,000.00	0.31
44	000673	当代东方	291,300	4,037,418.00	0.31
45	600268	国电南自	442,600	3,992,252.00	0.31
46	000048	康达尔	104,800	3,974,016.00	0.31
47	300344	太空板业	248,400	3,959,496.00	0.31
48	300343	联创互联	163,700	3,912,430.00	0.30
49	000862	银星能源	452,600	3,847,100.00	0.30
50	000985	大庆华科	124,586	3,824,790.20	0.30
51	300211	亿通科技	308,335	3,823,354.00	0.30
52	600115	东方航空	540,200	3,819,214.00	0.30
53	002032	苏泊尔	109,100	3,809,772.00	0.29
54	002726	龙大肉食	218,000	3,799,740.00	0.29
55	600083	博信股份	155,000	3,799,050.00	0.29
56	603808	歌力思	118,200	3,793,038.00	0.29
57	600009	上海机场	142,729	3,785,173.08	0.29
58	002545	东方铁塔	339,500	3,782,030.00	0.29
59	002220	天宝股份	280,100	3,778,549.00	0.29
60	000662	天夏智慧	176,900	3,766,201.00	0.29
61	002321	华英农业	350,500	3,753,855.00	0.29

62	000572	海马汽车	700,200	3,753,072.00	0.29
63	000636	风华高科	382,300	3,731,248.00	0.29
64	002519	银河电子	166,200	3,722,880.00	0.29
65	600262	北方股份	123,200	3,716,944.00	0.29
66	300050	世纪鼎利	283,500	3,716,685.00	0.29
67	600858	银座股份	397,000	3,715,920.00	0.29
68	300313	天山生物	195,300	3,710,700.00	0.29
69	601992	金隅股份	829,900	3,701,354.00	0.29
70	300260	新莱应材	110,000	3,691,600.00	0.29
71	000971	高升控股	156,000	3,689,400.00	0.28
72	603100	川仪股份	236,000	3,681,600.00	0.28
73	300420	五洋科技	147,200	3,677,056.00	0.28
74	601996	丰林集团	389,700	3,663,180.00	0.28
75	002383	合众思壮	74,000	3,663,000.00	0.28
76	300476	胜宏科技	160,300	3,662,855.00	0.28
77	002484	江海股份	222,900	3,662,247.00	0.28
78	300339	润和软件	119,600	3,659,760.00	0.28
79	000023	深天地A	115,100	3,656,727.00	0.28
80	300036	超图软件	209,800	3,650,520.00	0.28
81	600167	联美控股	219,327	3,645,214.74	0.28
82	300252	金信诺	122,600	3,642,446.00	0.28
83	002589	瑞康医药	112,200	3,640,890.00	0.28
84	300389	艾比森	167,737	3,639,892.90	0.28
85	601007	金陵饭店	258,300	3,639,447.00	0.28
86	002637	赞宇科技	258,800	3,636,140.00	0.28
87	600398	海澜之家	336,630	3,632,237.70	0.28
88	300341	麦迪电气	332,600	3,625,340.00	0.28
89	300220	金运激光	124,500	3,620,460.00	0.28

90	300462	华铭智能	104,700	3,617,385.00	0.28
91	002187	广百股份	256,100	3,616,132.00	0.28
92	600510	黑牡丹	418,500	3,611,655.00	0.28
93	300407	凯发电气	199,374	3,606,675.66	0.28
94	002217	合力泰	201,400	3,605,060.00	0.28
95	002583	海能达	272,600	3,601,046.00	0.28
96	000040	东旭蓝天	293,000	3,600,970.00	0.28
97	600289	亿阳信通	278,000	3,600,100.00	0.28
98	600748	上实发展	439,350	3,598,276.50	0.28
99	300177	中海达	242,200	3,596,670.00	0.28
100	600178	东安动力	325,500	3,593,520.00	0.28
101	300281	金明精机	199,000	3,591,950.00	0.28
102	002253	川大智胜	144,000	3,591,360.00	0.28
103	000705	浙江震元	274,500	3,587,715.00	0.28
104	300269	联建光电	155,100	3,585,912.00	0.28
105	002561	徐家汇	186,449	3,585,414.27	0.28
106	300390	天华超净	286,100	3,581,972.00	0.28
107	002302	西部建设	481,200	3,580,128.00	0.28
108	000030	富奥股份	421,000	3,578,500.00	0.28
109	300166	东方国信	172,100	3,577,959.00	0.28
110	002356	赫美集团	147,713	3,574,654.60	0.28
111	300356	光一科技	103,459	3,574,508.45	0.28
112	300342	天银机电	155,303	3,571,969.00	0.28
113	002511	中顺洁柔	179,453	3,571,114.70	0.28
114	002724	海洋王	138,100	3,568,504.00	0.28
115	300048	合康新能	434,000	3,567,480.00	0.28
116	601098	中南传媒	214,054	3,566,139.64	0.28
117	002218	拓日新能	396,500	3,564,535.00	0.28

118	002641	永高股份	423,100	3,558,271.00	0.27
119	002740	爱迪尔	230,100	3,557,346.00	0.27
120	300061	康耐特	154,194	3,551,087.82	0.27
121	300038	梅泰诺	81,100	3,547,314.00	0.27
122	002195	二三四五	313,200	3,545,424.00	0.27
123	300042	朗科科技	112,350	3,544,642.50	0.27
124	002103	广博股份	204,466	3,543,395.78	0.27
125	600203	福日电子	301,076	3,534,632.24	0.27
126	300210	森远股份	161,900	3,534,277.00	0.27
127	002536	西泵股份	249,900	3,528,588.00	0.27
128	603566	普莱柯	145,900	3,527,862.00	0.27
129	300041	回天新材	282,300	3,525,927.00	0.27
130	300287	飞利信	296,200	3,524,780.00	0.27
131	300468	四方精创	63,300	3,517,581.00	0.27
132	002705	新宝股份	207,900	3,515,589.00	0.27
133	600277	亿利洁能	494,000	3,512,340.00	0.27
134	002046	轴研科技	298,600	3,508,550.00	0.27
135	300326	凯利泰	315,400	3,507,248.00	0.27
136	000921	海信科龙	343,400	3,506,114.00	0.27
137	600250	南纺股份	224,300	3,501,323.00	0.27
138	600345	长江通信	153,900	3,496,608.00	0.27
139	002548	金新农	242,200	3,494,946.00	0.27
140	300119	瑞普生物	203,300	3,494,727.00	0.27
141	300138	晨光生物	191,700	3,494,691.00	0.27
142	300375	鹏翎股份	145,600	3,491,488.00	0.27
143	002416	爱施德	237,000	3,491,010.00	0.27
144	002373	千方科技	252,900	3,490,020.00	0.27
145	300370	安控科技	377,700	3,489,948.00	0.27

146	600190	锦州港	838,000	3,486,080.00	0.27
147	002753	永东股份	109,950	3,482,116.50	0.27
148	000938	紫光股份	60,600	3,477,834.00	0.27
149	600438	通威股份	545,600	3,475,472.00	0.27
150	600793	宜宾纸业	111,200	3,473,888.00	0.27
151	002520	日发精机	293,100	3,473,235.00	0.27
152	600589	广东榕泰	396,900	3,472,875.00	0.27
153	002232	启明信息	260,700	3,469,917.00	0.27
154	300121	阳谷华泰	190,316	3,469,460.68	0.27
155	300205	天喻信息	241,800	3,467,412.00	0.27
156	002674	兴业科技	195,212	3,466,965.12	0.27
157	002370	亚太药业	118,114	3,460,740.20	0.27
158	600455	博通股份	58,800	3,459,204.00	0.27
159	002537	海立美达	106,800	3,458,184.00	0.27
160	002371	七星电子	130,000	3,458,000.00	0.27
161	002271	东方雨虹	159,300	3,455,217.00	0.27
162	000815	美利云	168,100	3,454,455.00	0.27
163	300173	智慧松德	209,000	3,450,590.00	0.27
164	002016	世荣兆业	360,500	3,449,985.00	0.27
165	002567	唐人神	272,800	3,448,192.00	0.27
166	300419	浩丰科技	121,100	3,446,506.00	0.27
167	300158	振东制药	175,900	3,444,122.00	0.27
168	300353	东土科技	226,200	3,435,978.00	0.27
169	002382	蓝帆医疗	282,200	3,434,374.00	0.27
170	002015	霞客环保	389,400	3,430,614.00	0.26
171	002214	大立科技	310,215	3,427,875.75	0.26
172	600677	航天通信	199,500	3,427,410.00	0.26
173	603008	喜临门	187,000	3,422,100.00	0.26

174	002092	中泰化学	282,600	3,419,460.00	0.26
175	002324	普利特	114,500	3,418,970.00	0.26
176	603030	全筑股份	112,790	3,418,664.90	0.26
177	002376	新北洋	275,500	3,416,200.00	0.26
178	002706	良信电器	131,100	3,405,978.00	0.26
179	300067	安诺其	396,000	3,405,600.00	0.26
180	002152	广电运通	256,100	3,401,008.00	0.26
181	300241	瑞丰光电	210,600	3,396,978.00	0.26
182	300448	浩云科技	113,600	3,394,368.00	0.26
183	600429	三元股份	431,843	3,389,967.55	0.26
184	300289	利德曼	271,800	3,383,910.00	0.26
185	300461	田中精机	53,000	3,382,990.00	0.26
186	300303	聚飞光电	383,200	3,379,824.00	0.26
187	603003	龙宇燃油	167,500	3,373,450.00	0.26
188	601633	长城汽车	304,900	3,372,194.00	0.26
189	600980	北矿科技	136,900	3,367,740.00	0.26
190	000561	烽火电子	275,700	3,360,783.00	0.26
191	000910	大亚圣象	175,713	3,356,118.30	0.26
192	300310	宜通世纪	137,800	3,354,052.00	0.26
193	300264	佳创视讯	315,500	3,344,300.00	0.26
194	600585	海螺水泥	197,100	3,342,816.00	0.26
195	600551	时代出版	164,500	3,342,640.00	0.26
196	000732	泰禾集团	188,800	3,339,872.00	0.26
197	002714	牧原股份	142,700	3,322,056.00	0.26
198	600522	中天科技	314,600	3,312,738.00	0.26
199	002395	双象股份	143,900	3,302,505.00	0.26
200	300010	立思辰	198,700	3,302,394.00	0.26
201	601601	中国太保	118,210	3,282,691.70	0.25

202	002380	科远股份	114,100	3,282,657.00	0.25
203	600015	华夏银行	302,400	3,281,040.00	0.25
204	000034	神州数码	146,900	3,278,808.00	0.25
205	000421	南京公用	368,700	3,277,743.00	0.25
206	000502	绿景控股	154,600	3,277,520.00	0.25
207	300265	通光线缆	222,082	3,275,709.50	0.25
208	603099	长白山	166,600	3,272,024.00	0.25
209	000915	山大华特	77,500	3,265,075.00	0.25
210	002417	三元达	200,900	3,264,625.00	0.25
211	002048	宁波华翔	147,400	3,263,436.00	0.25
212	600241	时代万恒	210,800	3,258,968.00	0.25
213	600385	山东金泰	136,800	3,257,208.00	0.25
214	002006	精工科技	290,500	3,253,600.00	0.25
215	300261	雅本化学	336,304	3,252,059.68	0.25
216	603456	九洲药业	150,600	3,248,442.00	0.25
217	002354	天神娱乐	46,700	3,229,772.00	0.25
218	300209	天泽信息	129,800	3,229,424.00	0.25
219	000525	红太阳	186,500	3,211,530.00	0.25
220	002493	荣盛石化	208,200	3,210,444.00	0.25
221	600671	天目药业	104,200	3,210,402.00	0.25
222	002633	申科股份	117,400	3,209,716.00	0.25
223	002738	中矿资源	121,102	3,193,459.74	0.25
224	002149	西部材料	113,400	3,180,870.00	0.25
225	300141	和顺电气	135,900	3,178,701.00	0.25
226	002146	荣盛发展	404,700	3,176,895.00	0.25
227	002261	拓维信息	266,000	3,170,720.00	0.24
228	300154	瑞凌股份	307,800	3,164,184.00	0.24
229	002270	华明装备	220,095	3,156,162.30	0.24

230	300305	裕兴股份	243,394	3,139,782.60	0.24
231	600665	天地源	589,600	3,130,776.00	0.24
232	300472	新元科技	89,300	3,125,500.00	0.24
233	002595	豪迈科技	147,900	3,113,295.00	0.24
234	002540	亚太科技	395,300	3,103,105.00	0.24
235	600792	云煤能源	534,900	3,097,071.00	0.24
236	002372	伟星新材	200,400	3,092,172.00	0.24
237	002693	双成药业	284,200	3,063,676.00	0.24
238	600845	宝信软件	173,335	3,057,629.40	0.24
239	002150	通润装备	183,500	3,036,925.00	0.23
240	000665	湖北广电	210,300	3,003,084.00	0.23
241	600287	江苏舜天	279,200	2,984,648.00	0.23
242	000411	英特集团	134,900	2,981,290.00	0.23
243	300002	神州泰岳	321,600	2,971,584.00	0.23
244	002534	杭锅股份	265,800	2,966,328.00	0.23
245	002059	云南旅游	247,100	2,957,787.00	0.23
246	002352	鼎泰新材	71,200	2,957,648.00	0.23
247	601188	龙江交通	543,300	2,955,552.00	0.23
248	600139	西部资源	264,200	2,953,756.00	0.23
249	300092	科新机电	211,500	2,935,620.00	0.23
250	002652	扬子新材	159,400	2,886,734.00	0.22
251	300397	天和防务	111,600	2,877,048.00	0.22
252	600780	通宝能源	514,800	2,846,844.00	0.22
253	600088	中视传媒	129,800	2,845,216.00	0.22
254	002466	天齐锂业	87,600	2,842,620.00	0.22
255	300162	雷曼股份	198,500	2,838,550.00	0.22
256	300412	迦南科技	80,291	2,818,214.10	0.22
257	002171	楚江新材	174,100	2,759,485.00	0.21

258	601100	恒立液压	169,600	2,723,776.00	0.21
259	600403	大有能源	475,300	2,709,210.00	0.21
260	300456	耐威科技	51,300	2,612,709.00	0.20
261	002461	珠江啤酒	214,700	2,587,135.00	0.20
262	002728	特一药业	96,243	2,582,199.69	0.20
263	600579	天华院	176,000	2,523,840.00	0.19
264	002677	浙江美大	215,060	2,516,202.00	0.19
265	002435	长江润发	120,485	2,514,521.95	0.19
266	002661	克明面业	149,400	2,462,112.00	0.19
267	002441	众业达	181,700	2,431,146.00	0.19
268	603939	益丰药房	78,246	2,319,211.44	0.18
269	300460	惠伦晶体	90,500	2,307,750.00	0.18
270	300125	易世达	76,700	2,285,660.00	0.18
271	300114	中航电测	99,900	2,275,722.00	0.18
272	002096	南岭民爆	154,600	2,233,970.00	0.17
273	002750	龙津药业	128,800	2,141,944.00	0.17
274	002659	中泰桥梁	74,700	1,626,219.00	0.13
275	002748	世龙实业	78,300	1,576,179.00	0.12
276	600819	耀皮玻璃	190,600	1,541,954.00	0.12
277	002239	奥特佳	78,500	1,231,665.00	0.10
278	000560	昆百大 A	109,700	1,140,880.00	0.09
279	600687	刚泰控股	56,000	919,520.00	0.07
280	600225	天津松江	132,000	876,480.00	0.07
281	002579	中京电子	53,200	727,776.00	0.06
282	002798	帝王洁具	7,200	482,400.00	0.04
283	600855	航天长峰	14,500	418,905.00	0.03
284	002034	美欣达	7,800	283,374.00	0.02
285	300480	光力科技	12,700	282,194.00	0.02

286	600475	华光股份	14,000	279,300.00	0.02
287	600837	海通证券	15,900	250,425.00	0.02
288	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.02
289	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
290	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
291	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
292	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.01
293	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
294	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01
295	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
296	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
297	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
298	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
299	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
300	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
301	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
302	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
303	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
304	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
305	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
306	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
307	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
308	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
309	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
310	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
311	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
312	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
313	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

314	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
315	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
316	300363	博腾股份	19	380.95	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	300365	恒华科技	12,763,206.37	5.17
2	002706	良信电器	12,277,652.13	4.97
3	300042	朗科科技	12,219,980.67	4.95
4	601677	明泰铝业	12,114,626.21	4.90
5	300417	南华仪器	10,941,752.54	4.43
6	300283	温州宏丰	10,542,772.82	4.27
7	300354	东华测试	10,156,654.70	4.11
8	300130	新国都	9,891,289.85	4.00
9	300277	海联讯	9,831,700.31	3.98
10	300346	南大光电	9,622,317.96	3.89
11	603088	宁波精达	9,502,879.42	3.85
12	002370	亚太药业	9,343,490.84	3.78
13	300341	麦迪电气	9,320,933.25	3.77
14	002520	日发精机	9,317,729.57	3.77
15	300154	瑞凌股份	9,287,988.60	3.76
16	603969	银龙股份	9,144,304.60	3.70
17	002296	辉煌科技	9,088,313.18	3.68
18	601098	中南传媒	8,939,962.98	3.62

19	300371	汇中股份	8,899,062.68	3.60
20	601579	会稽山	8,768,059.20	3.55
21	300112	万讯自控	8,713,992.92	3.53
22	600167	联美控股	8,694,820.63	3.52
23	600297	广汇汽车	8,685,357.31	3.51
24	002096	南岭民爆	8,664,353.96	3.51
25	300395	菲利华	8,606,983.32	3.48
26	002356	赫美集团	8,606,287.51	3.48
27	002750	龙津药业	8,581,105.47	3.47
28	603011	合锻智能	8,567,744.14	3.47
29	002014	永新股份	8,561,634.30	3.46
30	600828	茂业商业	8,491,496.44	3.44
31	002519	银河电子	8,381,219.15	3.39
32	002338	奥普光电	8,379,711.05	3.39
33	601137	博威合金	8,370,686.33	3.39
34	300390	天华超净	8,271,444.78	3.35
35	600593	大连圣亚	8,243,433.80	3.34
36	300211	亿通科技	8,243,017.46	3.34
37	300108	双龙股份	8,229,267.81	3.33
38	000880	潍柴重机	8,190,126.28	3.31
39	600004	白云机场	8,158,668.11	3.30
40	000550	江铃汽车	8,119,153.69	3.29
41	300437	清水源	8,102,188.29	3.28
42	002300	太阳电缆	8,005,963.02	3.24
43	300412	迦南科技	7,957,071.08	3.22
44	002302	西部建设	7,948,394.88	3.22
45	300389	艾比森	7,901,768.89	3.20
46	300194	福安药业	7,894,136.21	3.19

47	300114	中航电测	7,877,686.30	3.19
48	600373	中文传媒	7,862,574.55	3.18
49	600661	新南洋	7,854,764.44	3.18
50	300339	润和软件	7,760,123.74	3.14
51	002637	赞宇科技	7,730,609.61	3.13
52	300259	新天科技	7,716,770.10	3.12
53	300312	邦讯技术	7,713,121.93	3.12
54	600479	千金药业	7,707,345.13	3.12
55	600746	江苏索普	7,669,642.77	3.10
56	002209	达意隆	7,662,245.61	3.10
57	300393	中来股份	7,645,884.46	3.09
58	000429	粤高速 A	7,616,995.99	3.08
59	002182	云海金属	7,599,748.36	3.08
60	600429	三元股份	7,561,176.35	3.06
61	002705	新宝股份	7,535,152.70	3.05
62	300281	金明精机	7,511,229.69	3.04
63	300241	瑞丰光电	7,499,695.15	3.04
64	600882	广泽股份	7,389,610.07	2.99
65	000862	银星能源	7,354,320.88	2.98
66	600757	长江传媒	7,328,578.99	2.97
67	600468	百利电气	7,310,031.09	2.96
68	600262	北方股份	7,288,276.09	2.95
69	002395	双象股份	7,284,386.45	2.95
70	600829	人民同泰	7,212,568.94	2.92
71	002667	鞍重股份	7,205,185.52	2.92
72	600083	博信股份	7,196,340.46	2.91
73	300375	鹏翎股份	7,081,748.20	2.87
74	600452	涪陵电力	7,046,353.26	2.85

75	300174	元力股份	7,019,622.98	2.84
76	600309	万华化学	7,005,867.96	2.84
77	300382	斯莱克	7,005,791.60	2.84
78	000985	大庆华科	6,996,426.22	2.83
79	300415	伊之密	6,960,358.87	2.82
80	000546	金圆股份	6,911,390.26	2.80
81	002589	瑞康医药	6,895,653.22	2.79
82	300138	晨光生物	6,884,707.44	2.79
83	300306	远方光电	6,824,964.06	2.76
84	300258	精锻科技	6,823,765.56	2.76
85	002032	苏泊尔	6,810,969.19	2.76
86	300270	中威电子	6,762,063.73	2.74
87	002247	帝龙文化	6,752,517.70	2.73
88	002532	新界泵业	6,742,928.88	2.73
89	002738	中矿资源	6,736,357.62	2.73
90	300287	飞利信	6,733,104.80	2.72
91	601328	交通银行	6,710,358.00	2.72
92	300210	森远股份	6,706,042.29	2.71
93	600538	国发股份	6,675,678.97	2.70
94	002430	杭氧股份	6,621,233.97	2.68
95	000040	东旭蓝天	6,602,539.22	2.67
96	300464	星徽精密	6,595,155.16	2.67
97	002143	印纪传媒	6,585,367.32	2.67
98	300269	联建光电	6,580,903.12	2.66
99	600683	京投发展	6,571,776.71	2.66
100	000921	海信科龙	6,570,717.35	2.66
101	601100	恒立液压	6,544,924.21	2.65
102	600483	福能股份	6,490,255.46	2.63

103	300048	合康新能	6,457,992.50	2.61
104	002518	科士达	6,414,803.81	2.60
105	600356	恒丰纸业	6,389,532.14	2.59
106	000695	滨海能源	6,388,531.54	2.59
107	002110	三钢闽光	6,381,395.76	2.58
108	000759	中百集团	6,369,746.18	2.58
109	000967	盈峰环境	6,322,512.94	2.56
110	002187	广百股份	6,276,577.18	2.54
111	300313	天山生物	6,269,650.21	2.54
112	300310	宜通世纪	6,267,638.27	2.54
113	600613	神奇制药	6,262,503.51	2.53
114	300419	浩丰科技	6,176,239.65	2.50
115	600015	华夏银行	6,150,993.86	2.49
116	300305	裕兴股份	6,141,578.13	2.49
117	300252	金信诺	6,133,961.43	2.48
118	002218	拓日新能	6,119,498.05	2.48
119	600178	东安动力	6,020,762.93	2.44
120	603008	喜临门	6,004,358.85	2.43
121	300286	安科瑞	5,999,990.35	2.43
122	000732	泰禾集团	5,978,897.28	2.42
123	300041	回天新材	5,929,411.48	2.40
124	603158	腾龙股份	5,924,694.09	2.40
125	002087	新野纺织	5,918,520.49	2.40
126	002724	海洋王	5,917,988.31	2.40
127	002493	荣盛石化	5,912,045.34	2.39
128	002217	合力泰	5,910,019.64	2.39
129	002714	牧原股份	5,894,760.57	2.39
130	300342	天银机电	5,890,609.78	2.38

131	002641	永高股份	5,884,724.44	2.38
132	002103	广博股份	5,884,140.43	2.38
133	000587	金洲慈航	5,883,506.00	2.38
134	600819	耀皮玻璃	5,875,495.65	2.38
135	603885	吉祥航空	5,873,004.02	2.38
136	300010	立思辰	5,864,930.10	2.37
137	600191	华资实业	5,856,272.84	2.37
138	300119	瑞普生物	5,850,020.28	2.37
139	300158	振东制药	5,837,608.39	2.36
140	002723	金莱特	5,835,026.14	2.36
141	600984	建设机械	5,817,151.21	2.35
142	002545	东方铁塔	5,798,502.38	2.35
143	002295	精艺股份	5,794,024.07	2.34
144	600416	湘电股份	5,792,087.60	2.34
145	600858	银座股份	5,775,487.65	2.34
146	600579	天华院	5,755,396.65	2.33
147	600507	方大特钢	5,738,869.70	2.32
148	300320	海达股份	5,735,405.09	2.32
149	600792	云煤能源	5,733,202.73	2.32
150	601566	九牧王	5,726,694.54	2.32
151	600243	青海华鼎	5,713,384.77	2.31
152	300036	超图软件	5,708,338.97	2.31
153	000056	皇庭国际	5,708,004.63	2.31
154	601139	深圳燃气	5,693,394.04	2.30
155	600510	黑牡丹	5,679,193.48	2.30
156	600250	南纺股份	5,656,086.91	2.29
157	600723	首商股份	5,621,114.74	2.27
158	603609	禾丰牧业	5,613,500.00	2.27

159	300405	科隆精化	5,604,597.50	2.27
160	002107	沃华医药	5,602,440.24	2.27
161	600551	时代出版	5,592,189.83	2.26
162	600629	华建集团	5,578,578.36	2.26
163	002693	双成药业	5,544,987.89	2.24
164	300407	凯发电气	5,531,182.42	2.24
165	000705	浙江震元	5,513,290.70	2.23
166	600203	福日电子	5,482,489.57	2.22
167	600980	北矿科技	5,482,273.78	2.22
168	000421	南京公用	5,469,484.26	2.21
169	300319	麦捷科技	5,464,491.81	2.21
170	603456	九洲药业	5,453,227.58	2.21
171	600831	广电网络	5,450,134.11	2.21
172	600780	通宝能源	5,440,105.53	2.20
173	601188	龙江交通	5,437,379.57	2.20
174	300061	康耐特	5,436,068.09	2.20
175	600845	宝信软件	5,386,993.52	2.18
176	000156	华数传媒	5,385,331.51	2.18
177	600241	时代万恒	5,369,391.06	2.17
178	300121	阳谷华泰	5,348,332.59	2.16
179	300050	世纪鼎利	5,277,496.66	2.14
180	600190	锦州港	5,275,294.72	2.13
181	002150	通润装备	5,274,298.36	2.13
182	000411	英特集团	5,261,258.48	2.13
183	000906	浙商中拓	5,256,527.74	2.13
184	002713	东易日盛	5,253,452.11	2.13
185	300249	依米康	5,246,989.39	2.12
186	300321	同大股份	5,236,316.78	2.12

187	603333	明星电缆	5,228,919.62	2.12
188	600665	天地源	5,225,391.99	2.11
189	002046	轴研科技	5,202,775.88	2.11
190	600892	大晟文化	5,160,207.20	2.09
191	002376	新北洋	5,147,845.00	2.08
192	600403	大有能源	5,145,309.82	2.08
193	002416	爱施德	5,145,207.70	2.08
194	300452	山河药辅	5,141,140.47	2.08
195	000665	湖北广电	5,140,370.96	2.08
196	603939	益丰药房	5,140,254.29	2.08
197	600438	通威股份	5,139,929.26	2.08
198	002534	杭锅股份	5,108,548.16	2.07
199	002059	云南旅游	5,004,971.78	2.03
200	600900	长江电力	5,001,504.00	2.02
201	000048	康达尔	4,987,070.05	2.02
202	002484	江海股份	4,985,578.34	2.02
203	002583	海能达	4,983,365.75	2.02
204	000034	神州数码	4,981,098.90	2.02
205	000926	福星股份	4,970,568.17	2.01
206	300462	华铭智能	4,964,635.68	2.01
207	002279	久其软件	4,959,993.36	2.01
208	300087	荃银高科	4,958,927.27	2.01
209	002747	埃斯顿	4,955,624.77	2.01
210	600383	金地集团	4,948,620.00	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	300371	汇中股份	9,534,718.90	3.86
2	603088	宁波精达	9,447,745.40	3.82
3	002706	良信电器	9,404,143.44	3.81
4	300042	朗科科技	9,002,981.25	3.64
5	601579	会稽山	8,876,128.18	3.59
6	300393	中来股份	8,775,443.72	3.55
7	600593	大连圣亚	8,562,383.96	3.47
8	002110	三钢闽光	8,553,819.42	3.46
9	000429	粤高速 A	8,457,132.26	3.42
10	300194	福安药业	8,235,984.05	3.33
11	002014	永新股份	8,219,929.21	3.33
12	600828	茂业商业	8,164,791.01	3.30
13	300174	元力股份	8,088,136.96	3.27
14	300382	斯莱克	7,881,569.95	3.19
15	000028	国药一致	7,795,711.98	3.15
16	300258	精锻科技	7,692,718.71	3.11
17	600757	长江传媒	7,594,347.02	3.07
18	002518	科士达	7,521,762.07	3.04
19	000550	江铃汽车	7,381,448.66	2.99
20	600452	涪陵电力	7,371,434.91	2.98
21	600829	人民同泰	7,204,917.39	2.92
22	300417	南华仪器	7,109,745.15	2.88
23	600468	百利电气	7,105,838.64	2.88
24	300415	伊之密	6,968,562.69	2.82
25	600538	国发股份	6,859,381.00	2.78
26	600683	京投发展	6,829,113.68	2.76

27	002143	印纪传媒	6,804,962.90	2.75
28	300405	科隆精化	6,785,412.23	2.75
29	002247	帝龙文化	6,757,297.46	2.73
30	000759	中百集团	6,705,934.22	2.71
31	601328	交通银行	6,700,115.82	2.71
32	600356	恒丰纸业	6,670,009.73	2.70
33	002096	南岭民爆	6,522,221.47	2.64
34	002532	新界泵业	6,512,579.23	2.64
35	603158	腾龙股份	6,431,610.78	2.60
36	600483	福能股份	6,427,831.10	2.60
37	600416	湘电股份	6,368,530.92	2.58
38	002750	龙津药业	6,353,174.00	2.57
39	300286	安科瑞	6,289,544.37	2.55
40	002713	东易日盛	6,238,146.00	2.52
41	300320	海达股份	6,209,172.44	2.51
42	300154	瑞凌股份	6,126,909.90	2.48
43	002370	亚太药业	6,088,155.60	2.46
44	300319	麦捷科技	6,086,933.03	2.46
45	600613	神奇制药	6,082,751.31	2.46
46	300341	麦迪电气	6,057,566.20	2.45
47	603609	禾丰牧业	6,048,588.80	2.45
48	002520	日发精机	6,029,538.41	2.44
49	000967	盈峰环境	5,975,823.76	2.42
50	002087	新野纺织	5,970,735.75	2.42
51	002295	精艺股份	5,931,781.01	2.40
52	300114	中航电测	5,877,578.64	2.38
53	600629	华建集团	5,843,047.33	2.36
54	601139	深圳燃气	5,821,368.94	2.36

55	600243	青海华鼎	5,820,915.73	2.36
56	000695	滨海能源	5,812,355.72	2.35
57	000056	皇庭国际	5,623,252.39	2.28
58	600095	哈高科	5,610,512.86	2.27
59	600191	华资实业	5,593,682.79	2.26
60	601098	中南传媒	5,588,079.14	2.26
61	601566	九牧王	5,578,120.23	2.26
62	000587	金洲慈航	5,532,576.93	2.24
63	000715	中兴商业	5,522,108.04	2.23
64	600723	首商股份	5,500,504.87	2.23
65	000906	浙商中拓	5,477,784.15	2.22
66	002107	沃华医药	5,454,781.10	2.21
67	000951	中国重汽	5,431,902.65	2.20
68	002691	冀凯股份	5,406,967.10	2.19
69	600984	建设机械	5,387,144.73	2.18
70	300211	亿通科技	5,362,364.58	2.17
71	300412	迦南科技	5,351,687.64	2.17
72	300249	依米康	5,327,541.50	2.16
73	600831	广电网络	5,278,642.45	2.14
74	601116	三江购物	5,223,473.20	2.11
75	000156	华数传媒	5,193,632.36	2.10
76	600393	粤泰股份	5,188,441.00	2.10
77	300321	同大股份	5,166,293.89	2.09
78	600383	金地集团	5,153,164.16	2.09
79	601003	柳钢股份	5,149,921.71	2.08
80	600167	联美控股	5,134,759.28	2.08
81	601233	桐昆股份	5,127,784.70	2.08
82	600658	电子城	5,127,120.43	2.07

83	002723	金莱特	5,117,202.14	2.07
84	300452	山河药辅	5,047,584.95	2.04
85	300281	金明精机	5,046,146.38	2.04
86	601677	明泰铝业	5,039,540.68	2.04
87	300087	荃银高科	5,034,797.89	2.04
88	002519	银河电子	5,005,161.22	2.03
89	002300	太阳电缆	4,961,508.03	2.01
90	603806	福斯特	4,950,784.95	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	3,592,716,625.44
卖出股票收入（成交）总额	2,758,450,396.70

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1701	IC1701	91	113,153,040.00	-1,250,877.80	-
公允价值变动总额合计（元）					-1,250,877.80
股指期货投资本期收益（元）					500,517.80
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,153,237.80

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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	23,102,590.24
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	26,947.85
5	应收申购款	7,861,232.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,990,770.35

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股票。

§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
41,390	24,041.39	202,652,720.67	20.37%	792,420,526.29	79.63%

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	447,430.66	0.0450%

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

注：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月29日）基金份额总额	481,169,673.62
本报告期期初基金份额总额	200,917,883.43
本报告期基金总申购份额	1,206,038,856.87
减:本报告期基金总赎回份额	411,883,493.34
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	995,073,246.96

§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 55000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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	
长江证券	1	11,465,532,275.78	23.09%	1,335,545.62	22.92%	-
华泰证券	2	1,264,550,567.57	19.93%	1,160,542.06	19.92%	-
中信证券	1	618,208,728.23	9.74%	563,376.23	9.67%	-
兴业证券	1	616,012,484.27	9.71%	561,373.62	9.63%	-
银河证券	2	373,046,895.77	5.88%	339,959.24	5.83%	-
中信建投	2	265,846,846.86	4.19%	247,561.19	4.25%	-
第一创业	1	243,739,303.80	3.84%	226,994.71	3.90%	-
申银万国	1	242,637,370.27	3.82%	225,966.43	3.88%	-
中银国际	1	239,479,404.99	3.77%	223,027.71	3.83%	-
英大证券	1	210,738,115.85	3.32%	196,260.55	3.37%	-
民生证券	1	195,937,343.20	3.09%	182,476.68	3.13%	-
国信证券	1	174,736,941.04	2.75%	162,732.93	2.79%	-
东吴证券	1	147,479,600.36	2.32%	134,399.36	2.31%	-
广州证券	1	147,245,626.60	2.32%	137,129.87	2.35%	-
广发证券	2	94,690,075.79	1.49%	86,291.33	1.48%	-
中投证券	1	46,645,241.77	0.73%	43,440.93	0.75%	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	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。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	340,000,000.00	24.64%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	725,000,000.00	52.54%	-	-
中银国际	-	-	20,000,000.00	1.45%	-	-
英大证券	-	-	30,000,000.00	2.17%	-	-
民生证券	-	-	65,000,000.00	4.71%	-	-
国信证券	-	-	180,000,000.00	13.04%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	20,000,000.00	1.45%	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

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	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月5日
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6日
3	南方基金管理有限公司关于在2016年1月4日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月6日
4	南方基金管理有限公司关于在指	中国证券报、上海	2016年1月6日

	数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	证券报、证券时报	
5	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
6	南方基金关于旗下部分基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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 1 月 8 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加天风证券为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 8 日
8	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
9	南方基金关于旗下部分基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其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 1 月 25 日
10	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
11	南方基金关于旗下部分基金增加中经北证为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 29 日
12	南方量化成长股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2015 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 2 日

13	南方量化成长股票型证券投资基金招募说明书（更新） （2015 年第 1 号）	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 2 月 2 日
14	南方基金关于临时暂停电子直销 实时赎回业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 2 月 15 日
15	南方基金关于旗下部分基金增加 鼎信汇金为代销机构及开通相关 业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 3 月 9 日
16	南方基金关于旗下部分基金增加 泉州银行为代销机构及开通定投 和转换业务并参与其费率优惠活 动的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 3 月 25 日
17	南方基金管理有限公司电子交易 赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 3 月 28 日
18	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
19	南方基金关于旗下部分基金增加 德州银行为代销机构及开通相关 业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 4 月 15 日
20	南方基金关于旗下部分基金增加 徽商银行和广东南粤银行为代销 机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
21	南方基金关于旗下部分基金增加 天津银行为代销机构及开通相关 业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 5 月 10 日
22	南方基金关于旗下部分基金增加 汇成基金为代销机构及开通相关 业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 5 月 13 日
23	南方基金关于旗下部分基金增加	中国证券报、上海	2016 年 5 月 26 日

	潍坊银行为代销机构及开通相关业务的公告	证券报、证券时报	
24	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
25	南方基金关于旗下部分基金增加宁波银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 2 日
26	南方基金关于旗下部分基金增加泰隆银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 3 日
27	南方基金关于旗下部分基金增加余杭农村商业银行代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 23 日
28	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
29	南方基金关于旗下部分基金增加苏宁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 7 月 6 日
30	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
31	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
32	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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 28 日
33	南方基金关于旗下部分基金增加	中国证券报、上海	2016 年 7 月 29 日

	万得投顾为代销机构及开通相关业务的公告	证券报、证券时报	
34	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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年8月19日
35	南方基金关于旗下部分基金增加中正达广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9月6日
36	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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年9月9日
37	南方基金关于南方量化成长股票型证券投资基金增加安信证券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9月20日
38	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
39	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
40	南方基金关于旗下部分基金增加途牛金服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9月28日
41	南方基金关于旗下部分基金增加徽商期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年10月10日
42	南方基金关于旗下部分基金增加东海期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年10月11日

43	南方基金关于南方量化成长股票型证券投资基金增加中国工商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 10 月 11 日
44	南方基金关于旗下部分基金增加南京证券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 10 月 14 日
45	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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 11 月 9 日
46	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业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 11 月 16 日
47	南方基金关于旗下部分基金增加富阳农商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 11 月 22 日
48	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
49	南方基金关于旗下部分基金增加长春农商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 11 月 29 日
50	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 6 日
51	南方基金关于旗下部分基金增加东莞银行、广东南粤银行和盈米财富为代销机构及开通相关业务	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 14 日

	的公告		
52	南方基金关于旗下部分基金增加永安期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 14 日
53	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
54	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
55	南方基金关于旗下部分基金增加齐商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 12 月 23 日
56	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
57	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
58	南方基金关于旗下部分基金参加中国光大银行电子渠道基金定投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
59	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

§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量化成长股票型证券投资基金的文件。
- 2、南方量化成长股票型证券投资基金基金合同。
- 3、南方量化成长股票型证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

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>