

# 南方量化成长股票型证券投资基金 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

## §1 重要提示

### 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §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

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网 址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

## § 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

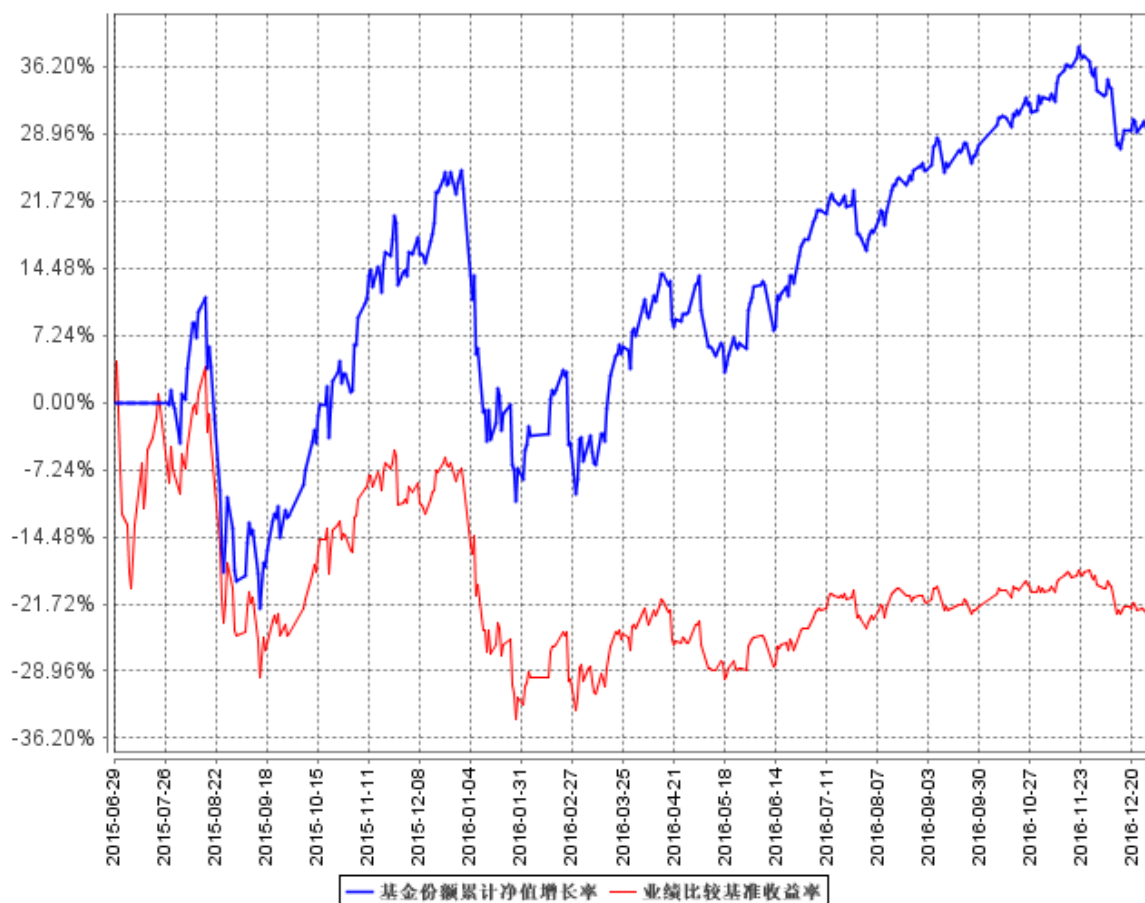
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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%

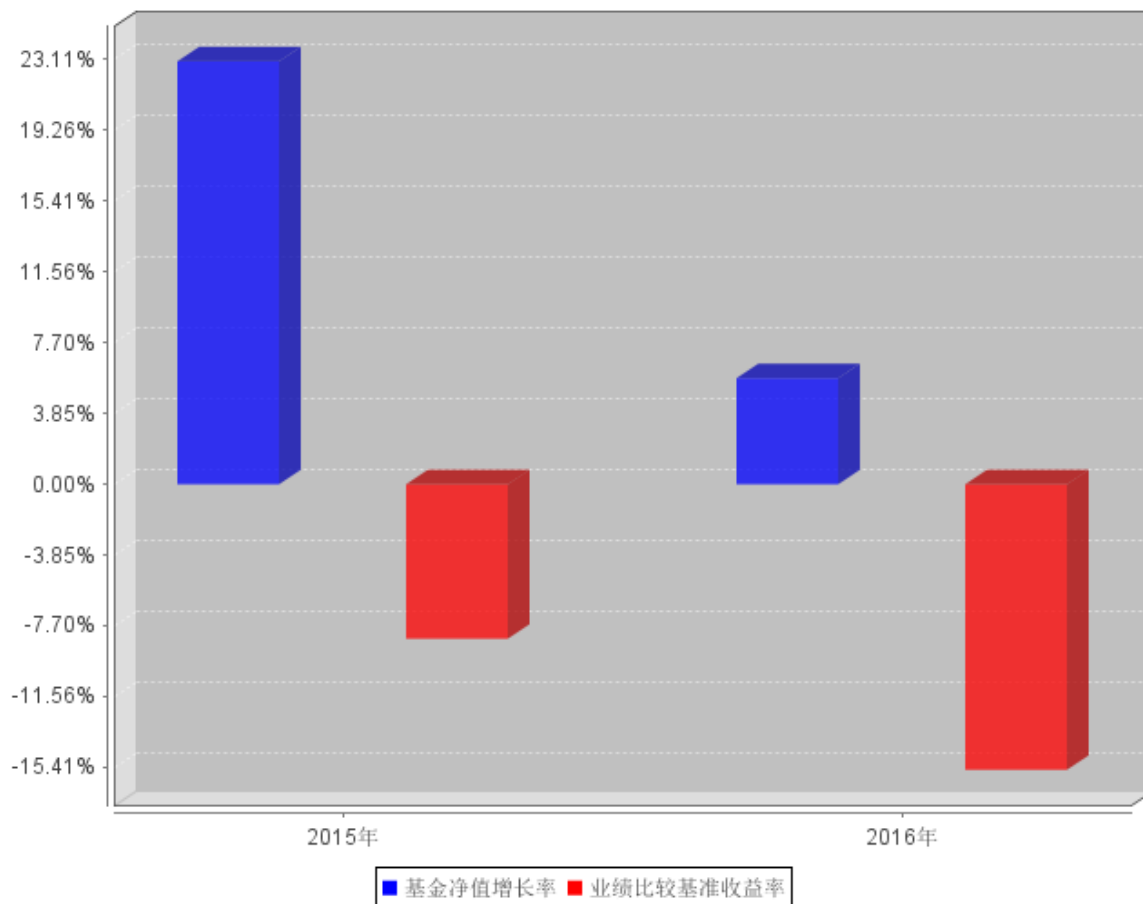
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

本基金 2016 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2017)第 21417 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §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	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	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	-	-
资产总计	1,315,787,363.34	250,321,160.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
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	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	261,078.93	109,864.18
负债合计	21,161,009.00	3,226,748.96
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	995,073,246.96	200,917,883.43
未分配利润	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	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
<b>一、收入</b>	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	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	58,929,208.38	54,316,035.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	500,517.80	1,661,960.00
股利收益	1,324,173.35	185,685.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-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）	2,257,712.61	921,576.69
<b>减：二、费用</b>	16,609,497.77	7,558,503.01
1. 管理人报酬	6,028,780.55	3,045,358.72
2. 托管费	1,004,796.65	507,559.73
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

#### 7.4.1.1 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。

#### 7.4.1.2 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。

#### 7.4.1.3 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。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 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。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 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%

##### 7.4.4.1.2 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。

**7.4.4.1.3 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。

**7.4.4.2 关联方报酬****7.4.4.2.1 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
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。

#### 7.4.4.2.2 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。

#### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

## 7.4.5 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

## 7.4.6 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.6.1 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	皖天然气	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	2016	2017	新股未 上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

	马	年	年	上市						
		12月	1月							
		30日	10日							
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。

#### 7.4.6.2 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	重大资产重组	24.98	2017年3月	27.48	147,200	3,613,705.50	3,677,056.00	-

		13 日			23 日						
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 28 日	重大资 产重组	20.32	-	-	164,500	3,436,637.96	3,342,640.00	-	-
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。

#### 7.4.6.3 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	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前十名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

## 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。