

# 南方全球精选配置证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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

基金简称	南方全球精选配置(QDII-FOF)
基金主代码	202801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年9月19日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,910,039,681.85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“南方全球”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过基金全球化的资产配置和组合管理，实现组合资产的分散化投资，在降低组合波动性的同时，实现基金资产的最大增值。
投资策略	<p>本基金在基金资产的配置上采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在有效分散风险的基础上，提高基金资产的收益。</p> <p>1、战略性资产配置策略 (Strategic Asset Allocation)</p> <p>在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类 (Asset Class) 与权重，并定期进行回顾和动态调整。</p> <p>2、战术性资产配置策略 (Tactical Asset Allocation)</p> <p>在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置，在不同国家的配置比例上采用“全球资产配置量化”模型进行配置和调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。</p> <p>本基金的大部分资产将投资于ETF基金、股票型基金和在香港市场投资于公开发行、上市的股票。利用定量和定性的方式筛选基金，在香港市场的选股策略的主要标准：</p> <p>市场及行业地位 (market position)、估值 (intrinsic value)、盈利预期 (earning surprise)、和良好的趋势 (investment trend)。</p>
业绩比较基准	60%×MSCI 世界指数 (MSCI World Index) +40%×MSCI 新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index)。
风险收益特征	本基金为基金中基金，属于中等偏高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平低于全球股票型基金、高于债券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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

## 2.4 境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

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、基金托管人的办公地址

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-118,909,156.75	1,220,269,930.79	1,133,709,108.99
本期利润	-78,318,895.71	317,443,523.35	717,406,953.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0125	0.0394	0.0539
本期基金份额净值增长率	-1.50%	-3.03%	7.84%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2116	-0.1998	-0.2219

期末基金资产净值	4,659,516,420.09	5,076,393,604.08	9,421,252,285.00
期末基金份额净值	0.788	0.800	0.825

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。

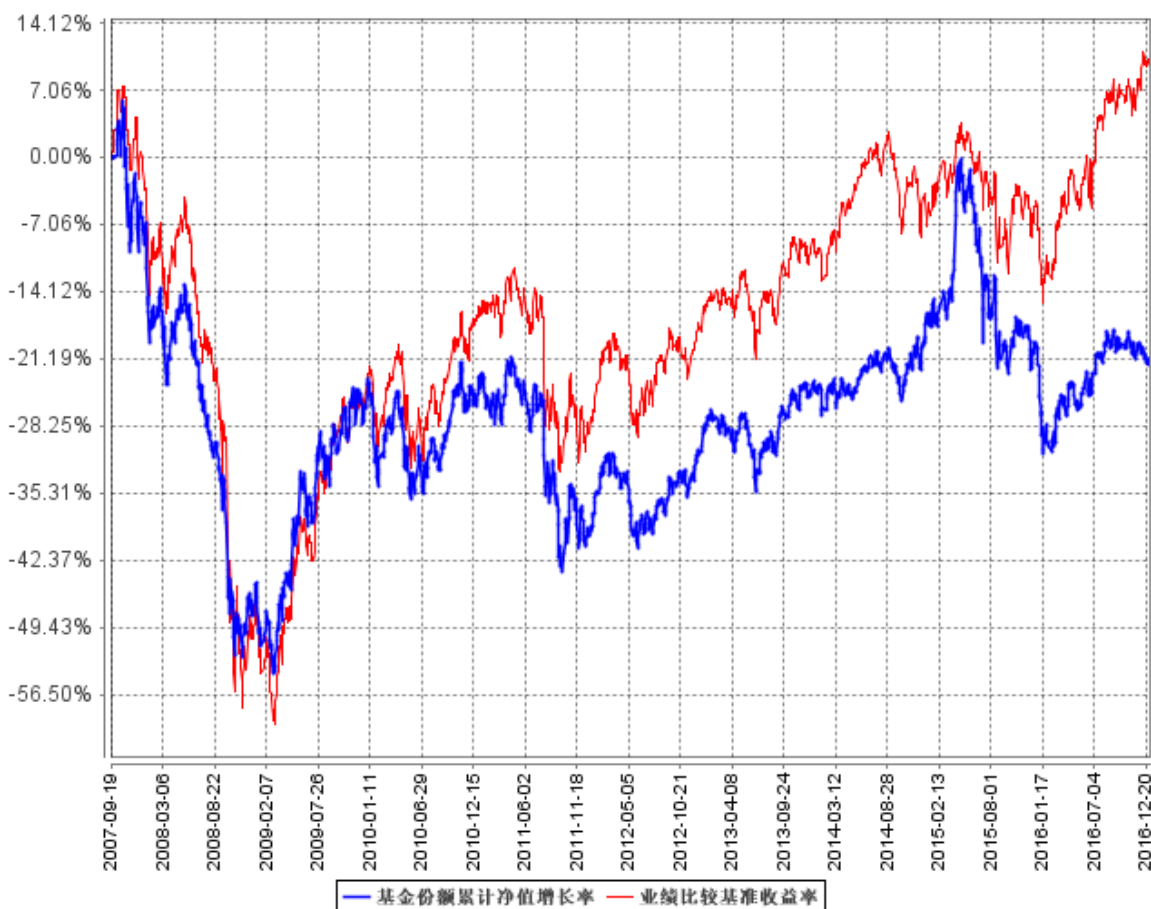
## 3.2 基金净值表现

### 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	-1.87%	0.48%	3.31%	0.54%	-5.18%	-0.06%
过去六个月	1.94%	0.53%	10.85%	0.58%	-8.91%	-0.05%
过去一年	-1.50%	0.81%	16.61%	0.84%	-18.11%	-0.03%
过去三年	3.01%	0.91%	20.68%	0.80%	-17.67%	0.11%
过去五年	30.68%	0.86%	54.86%	0.78%	-24.18%	0.08%
自基金合同生效起至今	-21.20%	1.19%	10.29%	1.30%	-31.49%	-0.11%

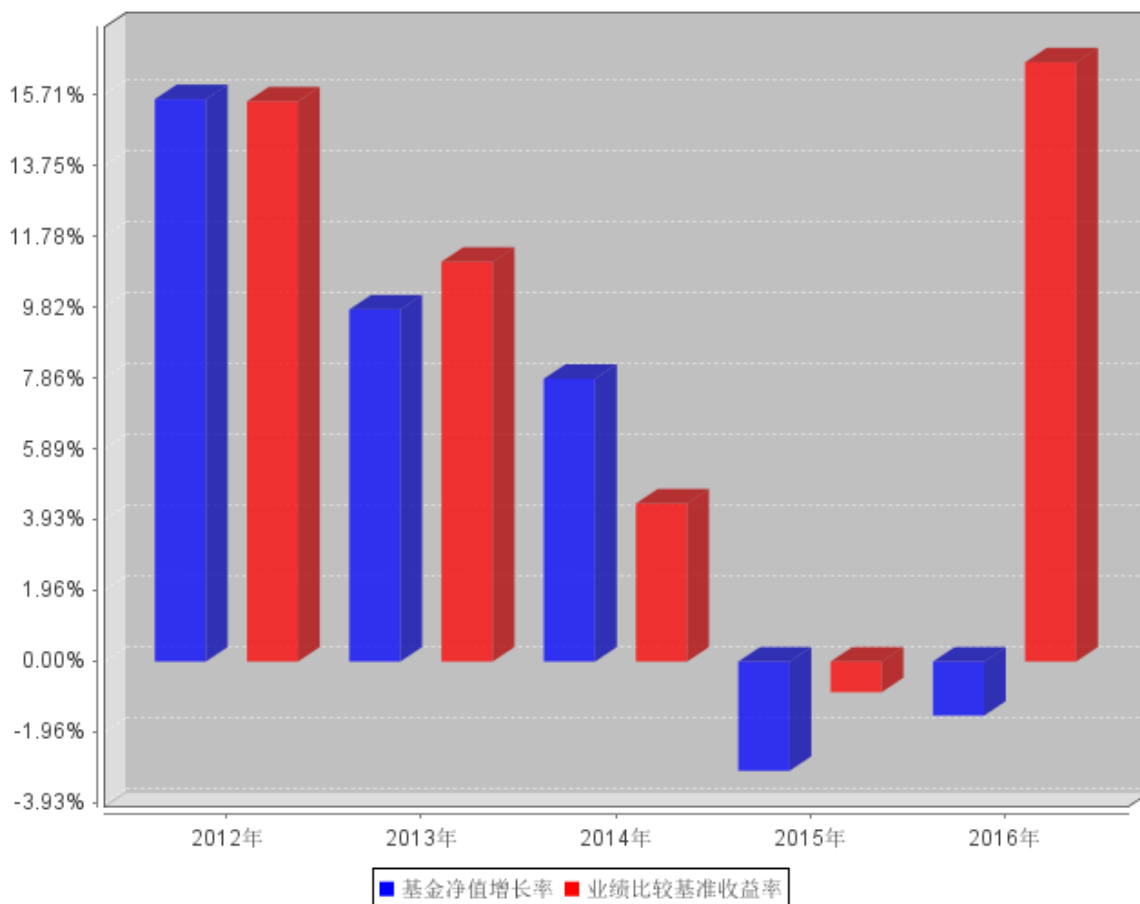
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模近 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		
黄亮	本基金基金经理	2009年6月25日	-	15年	北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司，2005年加入南方基金国际业务部，负责 QDII 产品设计及国际业务开拓工作，2007年9月至2009年5月，担任南方全球基金经理助理；2015年9月至今，任国际投资决策委员会委员；2016年5月至今，担任国际业务部执行总监；2009年6月至今，担任南方全球基金经理；2010年12月至今，任南方金砖基金经理；2011年9月至2015年5月，任南方中国中小盘基金经理；2015年5月至今，任南方香港优选基金经理；2016年6月至今，任南方原油基金经理。
蔡青	本基金基金经理	2015年5月28日	-	10年	女，英国朴茨茅斯大学金融决策分析专业硕士，具有基金从业资格。2006年7月加入南方基金，历任国际业务部研究员、高级研究员，现任国际业务部总监助理。2011年6月至2015年5月，担任南方全球的基金经理助理。2015年5月至今，任南方全球基金经理；2015年9月至今，任南方香港成长基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方全球精选配置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，两两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年全球资本市场经历了跌宕起伏的一年，年初在整体经济数据疲弱、对中国经济减速担忧升温以及朝鲜宣布氢弹试验成功的背景下，避险情绪迅速提升。原油、股票等风险类资产遭遇重创，黄金、美国国债等避险类资产受到追捧。进入一月下旬以后，随着欧洲央行行长德拉吉发表鸽派观点、美联储延迟加息、日本央行启动负利率政策、欧洲央行下调再融资利率，市场乐观情绪逐步升温。6月23日英国意外退出欧盟给市场带来短暂震荡，但未改变股市上涨趋势。三

季度在整体政治、经济情况较为平稳的环境下，全球股票市场取得较为显著的上涨。前三季度，在原油价格触底回升、美联储加息预期走弱的市场环境下，新兴市场股市的表现显著超越发达市场股市表现。

市场的转折点发生在第四季度，随着市场对美联储加息预期的升温，美元指数开始回升，美国、德国、日本国债收益率进入上行通道，MSCI 发达国家指数及 MSCI 新兴市场指数均掉头下行，黄金价格基本持平。2016 年 11 月 9 日特朗普当选美国总统后，市场悲观情绪在当天迅速释放，进而转向演绎通货膨胀预期升温的逻辑。美元指数及债券收益率大幅攀升，黄金价格跳水，股票市场方面资金加速回流至以美国为代表的发达市场，MSCI 发达国家指数及 MSCI 新兴市场指数走势出现分化。12 月 15 日，美联储议息会议决议加息 0.25%，符合市场预期，然而会后新闻发布会所传递的较为鹰派的观点进一步抬升了市场对通货膨胀抬头以及利率加速正常化的预期。

报告期间，按照 MSCI 发达国家指数按美元计价上涨 5.32%，MSCI 新兴市场指数按美元计价上涨 8.58%，恒生指数按港币计价上涨 0.39%，黄金价格按美元计价上涨 8.14%，十年期美国国债收益率回升了 17 个基点，十年期日本国债及十年期德国国债收益率分别下降了 22 和 42 个基点，美元指数上涨 3.63%。新兴市场主要国家股市报告期间出现分化，其中巴西圣保罗证交所指数按本币计价上涨 38.93%，俄罗斯 MICEX 指数按本币计价上涨 26.76%，印度则受困于年末废钞事件的短期影响，Nifty 指数按本币计价仅上涨 3.01%。MSCI 中国指数全年按本币计价下跌 1.38%。

2016 年港股市场受到资金回流发达市场的影响在全球主要市场中表现相对落后，恒生指数全年微涨 0.39%。在资产配置上，本基金维持了较为均衡的仓位水平。在投资策略上遵循先优选行业，再配置个股，其次注意持仓成本的原则。对金融、能源行业进行了较高比例的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2016 年基金净值增长-1.50%，基金基准增长 16.61%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年资本市场以股灾开始，以债灾结束，但纵观全年来看，MSCI 全球指数及 MSCI 新兴市场指数依然取得了近三年以来最好的表现。展望 2017 年一季度，随着市场通胀预期的充分发酵，预计美元指数上升、资金逃离债券市场及新兴市场股市并回流美国股市的势头将有所减弱，市场当前的主要分歧转移到特朗普财政政策的实际落实情况以及美国货币政策对新兴市场的影响。

2017 年全年来看，美国新政府的政策走向，英国开始与欧盟的脱欧谈判，以及各主要欧洲国家的大选仍将使市场充满不确定性。由于对央行流动性依赖的降低，政治风险上升，全球通胀水平抬头，各资产大类的相关性将开始减弱。资金将不再一味追逐收益率，而将更重视基本面。我

们对全球股市 2017 年的前景并不悲观，但欧洲以及部分新兴市场国家所面临的地缘政治风险以及贸易摩擦风险对资本市场的影响值得警惕。我们判断 2017 年仍然需要在波动中寻找机会，盈利出现边际改善的价值股值得重点关注。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 60%，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按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；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收益分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方全球精选配置（QDII-FOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，南方全球精选配置（QDII-FOF）的管理人——南方基金管理有限公司在南方全球精选配置（QDII-FOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方全球精选配置（QDII-FOF）未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方全球精选配置（QDII-FOF）2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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 21495 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：南方全球精选配置证券投资基金

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	828,178,137.06	182,391,493.53
结算备付金	-	-
存出保证金	2,012.65	1,885.01
交易性金融资产	3,816,672,705.80	4,968,138,791.61
其中：股票投资	770,604,152.01	1,643,901,341.02
基金投资	3,022,657,760.43	3,324,237,450.59
债券投资	23,410,793.36	-
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	28,329,652.11	-
应收利息	312,503.61	2,925.34
应收股利	283,079.35	6,050,719.78
应收申购款	116,530.51	182,601.26
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,673,894,621.09	5,156,768,416.53
<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	19.58	60,649,552.09
应付赎回款	5,060,564.25	10,165,755.76
应付管理人报酬	7,368,400.09	8,007,889.57
应付托管费	1,194,875.67	1,298,576.68
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	321,309.87	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	433,031.54	253,038.35
负债合计	14,378,201.00	80,374,812.45
<b>所有者权益：</b>		

实收基金	5,910,039,681.85	6,343,696,808.50
未分配利润	-1,250,523,261.76	-1,267,303,204.42
所有者权益合计	4,659,516,420.09	5,076,393,604.08
负债和所有者权益总计	4,673,894,621.09	5,156,768,416.53

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.788 元，基金份额总额

5,910,039,681.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方全球精选配置证券投资基金

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	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	44,425,432.68	512,610,756.84
1. 利息收入	856,715.24	706,302.92
其中：存款利息收入	673,963.34	706,302.92
债券利息收入	182,751.90	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-45,639,420.63	1,316,476,890.10
其中：股票投资收益	-164,495,054.72	571,095,837.04
基金投资收益	46,276,954.47	594,676,003.25
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	-	-
股利收益	72,578,679.62	150,705,049.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	40,590,261.04	-902,826,407.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	48,603,971.77	98,165,280.32
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	13,905.26	88,690.94
<b>减：二、费用</b>	122,744,328.39	195,167,233.49
1. 管理人报酬	87,531,774.99	128,983,368.11
2. 托管费	14,194,341.81	20,916,221.93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	20,497,613.20	44,094,456.56
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	520,598.39	1,173,186.89

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-78,318,895.71	317,443,523.35
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-78,318,895.71	317,443,523.35

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方全球精选配置证券投资基金

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）	6,343,696,808.50	-1,267,303,204.42	5,076,393,604.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-78,318,895.71	-78,318,895.71
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）	-433,657,126.65	95,098,838.37	-338,558,288.28
其中：1. 基金申购款	20,494,651.27	-4,830,697.67	15,663,953.60
2. 基金赎回款	-454,151,777.92	99,929,536.04	-354,222,241.88
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）	5,910,039,681.85	-1,250,523,261.76	4,659,516,420.09
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,423,939,925.42	-2,002,687,640.42	9,421,252,285.00
二、本期经营活动产生	-	317,443,523.35	317,443,523.35

的基金净值变动数（本期净利润）			
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）	-5,080,243,116.92	417,940,912.65	-4,662,302,204.27
其中：1. 基金申购款	114,082,014.35	-6,228,456.86	107,853,557.49
2. 基金赎回款	-5,194,325,131.27	424,169,369.51	-4,770,155,761.76
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）	6,343,696,808.50	-1,267,303,204.42	5,076,393,604.08

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：

          杨小松  徐超  徐超            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。



自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于2016年5月1日前)或增值税(自2016年5月1日起)且暂不征收企业所得税。

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

### 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司(“纽约梅隆银行”)	境外资产托管人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰金融控股(香港)有限公司(“华泰香港”)	基金管理人的股东华泰证券的子公司
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1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰香港	105,270,414.89	1.93%	717,375,914.43	4.91%

##### 7.4.4.1.2 基金交易

金额单位：人民币元

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

	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰香港	1,565,167,932.13	11.34%	2,842,172,612.56	11.98%

#### 7.4.4.1.3 权证交易

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。

#### 7.4.4.1.4 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
华泰香港	986,926.94	6.73%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰香港	2,251,789.73	8.29%	-	-

#### 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1月1日至 2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	87,531,774.99	128,983,368.11
其中：支付销售机构的客户维护费	11,295,791.66	16,732,502.89

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1.85%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 1.85% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至	上年度可比期间 2015年1月1日至
----	------------------	-----------------------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,194,341.81	20,916,221.93

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 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 × 0.30% / 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

本基金本报告期内无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

本基金各关联方于本报告期内及上年度可比期末未运用自有资金投资本基金。

#### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	638,559,618.64	664,365.84	19,067,239.44	706,100.56
纽约梅隆银行	189,618,518.42	-	163,324,254.09	-
合计	828,178,137.06	664,365.84	182,391,493.53	706,100.56

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

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末及上年度末未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

#### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限证券

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
GB00BVJF7G73	COBA CCB	2016 年	重大	102.67	2017 年	100.54	45,000	4,542,943.50	4,620,150.00	-

	RQFII MM CUITS RMB	12月30日	事项		1月 3日				
--	-----------------------	--------	----	--	----------	--	--	--	--

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基金，该类基金将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.5.3 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	770,604,152.01	16.49
	其中：普通股	770,604,152.01	16.49
	存托凭证	-	-
2	基金投资	2,692,536,306.10	57.61
3	固定收益投资	23,410,793.36	0.50
	其中：债券	23,410,793.36	0.50
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	330,121,454.33	7.06
7	银行存款和结算备付金合计	828,178,137.06	17.72
8	其他各项资产	29,043,778.23	0.62
9	合计	4,673,894,621.09	100.00

注：1、上述货币市场工具均为货币市场基金投资。

2、本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币 346,229,040.60 元，占基金资产净值比例 7.43%。

3、于 2016 年 12 月 31 日，债券投资包含优先股投资。

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币

元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	770,604,152.01	16.54
合计	770,604,152.01	16.54

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币

元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	-	-
必需消费品	13,131,406.80	0.28
金融	389,228,136.30	8.35
保健	138,275,033.01	2.97
工业	53,080,223.40	1.14
材料	6,843,001.50	0.15
能源	170,046,351.00	3.65
通讯	-	-
科技	-	-
公用事业	-	-
合计	770,604,152.01	16.54

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	China Resources Pharmaceutical Group Limited	华润医药集团有限公司	3320 HK	香港交易所	中国	17,666,500	138,275,033.01	2.97
2	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业集团有限公司	2669 HK	香港交易所	中国	111,000,000	132,056,511.30	2.83

3	China Energy Engineering Corporation Limited	中国能源建设股份有限公司	3996 HK	香港交易所	中国	43,000,000	53,080,223.40	1.14
4	PetroChina Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港交易所	中国	10,000,000	51,702,678.00	1.11
5	China Overseas Land And Investment Ltd.	中国海外发展有限公司	688 HK	香港交易所	中国	2,800,000	51,470,105.40	1.10
6	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	香港交易所	中国	2,000,000	49,645,305.00	1.07
7	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港交易所	中国	10,000,000	49,198,050.00	1.06
8	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港交易所	中国	5,000,000	43,383,735.00	0.93
9	Shanghai Industrial Holdings Limited	上海实业控股有限公司	363 HK	香港交易所	中国	2,200,000	41,326,362.00	0.89
10	China Vanke CO., LTD.	万科企业股份有限公司	2202 HK	香港交易所	中国	2,000,000	31,665,654.00	0.68

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	388 HK	337,129,684.79	6.64
2	China Overseas Land And Investment Ltd.	688 HK	246,107,409.61	4.85
3	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	198,729,177.61	3.91
4	Citic Securities Company Limited	6030 HK	197,412,240.30	3.89

5	China Resources Pharmaceutical Group Limited	3320 HK	139,700,296.92	2.75
6	PetroChina Company Limited	857 HK	127,876,141.29	2.52
7	Zhaojin Mining Industry Company Limited	1818 HK	97,852,839.02	1.93
8	CNOOC Limited	883 HK	96,830,169.06	1.91
9	CITIC Limited	267 HK	86,725,982.08	1.71
10	China Vanke CO.,LTD.	2202 HK	83,211,392.94	1.64
11	China Oilfield Services Limited	2883 HK	78,438,014.60	1.55
12	Dalian Wanda Commercial Properties Co.,Ltd	3699 HK	72,679,436.00	1.43
13	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	2318 HK	72,062,082.10	1.42
14	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	71,194,047.22	1.40
15	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	70,395,895.53	1.39
16	China Merchants Bank Co.,Ltd.	3968 HK	68,041,813.11	1.34
17	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	53,642,262.87	1.06
18	Haitong Securities Co.,Ltd.	6837 HK	47,737,670.75	0.94
19	Gf Securities Co.,Ltd.	1776 HK	44,975,175.84	0.89
20	Shanghai Industrial Holdings Limited	363 HK	35,868,228.06	0.71

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	388 HK	322,111,856.64	6.35
2	China Overseas Land And Investment Ltd.	688 HK	241,315,508.33	4.75
3	CITIC Limited	267 HK	202,221,379.90	3.98
4	Citic Securities Company Limited	6030 HK	197,647,018.50	3.89
5	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	181,587,455.51	3.58
6	China Merchants Bank Co.,Ltd.	3968 HK	160,265,183.42	3.16
7	Dalian Wanda Commercial Properties Co.,Ltd	3699 HK	156,662,368.92	3.09
8	CRRC Corporation Limited	1766 HK	137,013,005.35	2.70
9	Ck Hutchison Holdings Limited	1 HK	127,374,213.62	2.51
10	China Vanke CO.,LTD.	2202 HK	117,706,703.53	2.32
11	CNOOC Limited	883 HK	113,009,776.03	2.23

12	Shanghai Industrial Holdings Limited	363 HK	93,777,385.43	1.85
13	Zhaojin Mining Industry Company Limited	1818 HK	92,143,854.69	1.82
14	PetroChina Company Limited	857 HK	75,750,107.93	1.49
15	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	70,912,611.00	1.40
16	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	2318 HK	69,730,675.84	1.37
17	Shanghai Electric Group Company Limited	2727 HK	63,787,277.77	1.26
18	Jiangxi Copper Company Limited	358 HK	61,176,188.48	1.21
19	China Taiping Insurance Holdings Company Limited	966 HK	55,652,299.43	1.10
20	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	52,540,147.75	1.03

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,388,414,871.60
卖出收入（成交）总额	3,067,999,165.64

注：买入成本和卖出收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币

元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
其他	23,410,793.36	0.50

注：1、本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

2、于2016年12月31日，债券投资包含优先股投资。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-----------	------	--------------



1	XS1514052585	HSBANK 5 1/2 12/29/49	34,000	23,410,793.36	0.50
---	--------------	-----------------------	--------	---------------	------

注：于2016年12月31日，债券投资包含优先股投资。

## 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币

元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR GOLD SHARES (SPDR 黄金信托)	ETF 基金	开放式	SSgA Funds Management Inc (道富基金管理公司)	501,840,616.20	10.77
2	ISHARES MSCI HONG KONG ETF (iShares 安硕 MSCI 香港 ETF)	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors (贝莱德基金管理公司)	337,831,900.00	7.25
3	JPM LUX LIQUIDITY INSTITUTIONAL FUND (摩根大通货币市场基金)	货币市场基金	开放式	JP Morgan Asset Management (摩根大通资产管理公司)	330,121,454.33	7.08
4	ISHARES MSCI INDIA ETF (iShares 安硕 MSCI 印度 ETF)	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors (贝莱德基金管理公司)	258,513,548.30	5.55
5	ISHARES MSCI UNITED KINGDOM ETF (iShares 安硕 MSCI 英国 ETF)	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors (贝莱德基金管理公司)	212,896,530.00	4.57
6	ISHARES MSCI	ETF	开放式	BlackRock Fund	165,322,584.00	3.55

	GERMANY ETF(iShares 安硕 MSCI 德国 ETF)	基金		Advisors (贝莱德基 基金管理公司)		
7	POWERSHARES DB AGRICULTURE FUND(PowerShares 德银农业基金)	ETF 基金	开放式	Invesco PowerShares Capital Mgmt Ltd (景顺 PowerShares 资产管理 公司)	164,852,949.10	3.54
8	ENERGY SELECT SECTOR SPDR FUND(能源精选行业 SPDR 基金)	ETF 基金	开放式	SSgA Funds Management Inc (道 富基金管理公司)	156,748,452.00	3.36
9	ISHARES U. S. ENERGY ETF(iShares 安硕美 国能源 ETF)	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors (贝莱德基 基金管理公司)	144,081,490.00	3.09
10	FINANCIAL SELECT SECTOR SPDR FUND(金融精选行业 SPDR 基金)	ETF 基金	开放式	SSgA Funds Management Inc (道 富基金管理公司)	106,448,265.00	2.28

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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

### 8.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,012.65
2	应收证券清算款	28,329,652.11
3	应收股利	283,079.35
4	应收利息	312,503.61
5	应收申购款	116,530.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,043,778.23

**8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
357,187	16,546.07	18,060,778.85	0.31%	5,891,978,903.00	99.69%

**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	1,281,311.87	0.0217%

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2007年9月19日）基金份额总额	29,998,151,206.40
---------------------------	-------------------

本报告期期初基金份额总额	6,343,696,808.50
本报告期基金总申购份额	20,494,651.27
减:本报告期基金总赎回份额	454,151,777.92
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	5,910,039,681.85

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

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

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，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 128,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 10 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		基金交易		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	成交金额	占当期基金成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Merrill Lynch (Asia Pacific) Ltd	-	1,183,773,323.48	21.70%	973,841,262.47	7.06%	647,284.41	4.42%	-
BOCI Securities Limited	-	710,612,513.82	13.02%	1,866,061,142.65	13.52%	2,138,054.10	14.59%	-
First Shanghai Securities Ltd.	-	622,782,270.89	11.41%	52,565,124.96	0.38%	864,386.27	5.90%	-
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	569,940,785.41	10.45%	139,359,058.13	1.01%	709,368.58	4.84%	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	447,185,389.88	8.20%	3,685,277,328.99	26.70%	3,000,650.13	20.48%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	399,639,890.34	7.32%	2,515,611,729.34	18.22%	3,131,046.24	21.37%	-
海通证券	1	349,775,786.85	6.41%	-	-	349,775.77	2.39%	新增
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	-	307,884,122.08	5.64%	896,751,403.76	6.50%	786,633.56	5.37%	-
CITIC Securities International Company Limited	-	260,863,903.89	4.78%	84,928,373.90	0.62%	345,792.30	2.36%	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	250,011,485.39	4.58%	991,792,512.11	7.19%	862,820.16	5.89%	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	105,270,414.89	1.93%	1,565,167,932.13	11.34%	986,926.94	6.73%	-

Haitong International Securities Co.,Ltd	-	78,106,621.36	1.43%	-	-	78,106.62	0.53%	-
The Bank of New York Mellon	-	71,235,665.11	1.31%	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	55,829,016.29	1.02%	17,057,542.69	0.12%	75,052.05	0.51%	-
Morgan Stanley Asia Limited	-	43,502,847.56	0.80%	213,230,466.06	1.54%	221,923.68	1.51%	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	801,874,878.63	5.81%	456,338.88	3.11%	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
ABCI Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Construction Bank International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet Pacific Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Oriental Patron Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Business Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Commerzbank	-	-	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
SinoPac Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank A.G.London	-	-	-	-	-	-	-	-
Knight Capital Americas, L.P.	-	-	-	-	-	-	-	-
CSC Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Ping An of China Securities (HK) Co. Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Cantor Fitzgerald	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY ASIA SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC Dominion Securities Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
Taifook Securities Co.Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-	-	-

### 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
Merrill Lynch (Asia Pacific) Ltd	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	23,057,780.00	100.00%	-	-	-	-
First Shanghai Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation	-	-	-	-	-	-
Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-
The Bank of New York Mellon	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking	-	-	-	-	-	-

Corporation Limited						
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	-	-	-	-	-	-
CITI Group Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-
ABCI Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
China Construction Bank International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Instinet Pacific Limited	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
Oriental Patron Securities Limited	-	-	-	-	-	-
GuangFa Securities (Hong Kong)Business Limited	-	-	-	-	-	-
Commerzbank	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
SinoPac Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-
Nomura (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank A.G.London	-	-	-	-	-	-
Knight Capital Americas, L.P.	-	-	-	-	-	-
CSC Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
Ping An of China Securities (HK) Co. Ltd.	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Cantor Fitzgerald	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY ASIA SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-
RBC Dominion Securities Inc.	-	-	-	-	-	-
Taifook Securities Co.Ltd.	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

注：券商选择标准和程序：



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

#### A. 券商的选择

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

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

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

提供研究服务的质量。主要指券商承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座。

其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

#### B. 券商交易量分仓

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