

# 南方安心保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招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。

基金托管人招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	南方安心保本混合
基金主代码	202213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 21 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,844,305,818.73 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“南方安心”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略，在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金按照时间不变性投资组合保险（TIPP, Time Invariant Portfolio Protection）策略进行资产配置，以实现保本和增值的目标。TIPP 策略设置了一条保本投资底线，该底线随着投资组合收益的增加而调整。TIPP 策略改进了 CPPI 中保本投资底线的调整方式，每当收益率达到一定的比率并持续一段时间后，保本投资底线相应提高一定比例，以锁定一部分前期投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：三年期定期存款税后收益率+0.5%。
风险收益特征	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

## 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201

## 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、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
基金保证人	重庆三峡担保集团股份有限公司	重庆市渝中区中华路 178 号国际商务中心 6 楼

## § 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	28,390,415.53	437,199,465.88	165,646,753.69
本期利润	-10,609,974.24	340,402,100.76	335,531,001.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0027	0.3532	0.2114
本期基金份额净值增长率	-0.30%	26.55%	22.77%
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	0.0432	0.0464	0.1485

期末基金资产净值	3,832,216,193.10	3,983,744,681.99	1,513,212,249.20
期末基金份额净值	0.997	1.000	1.224

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

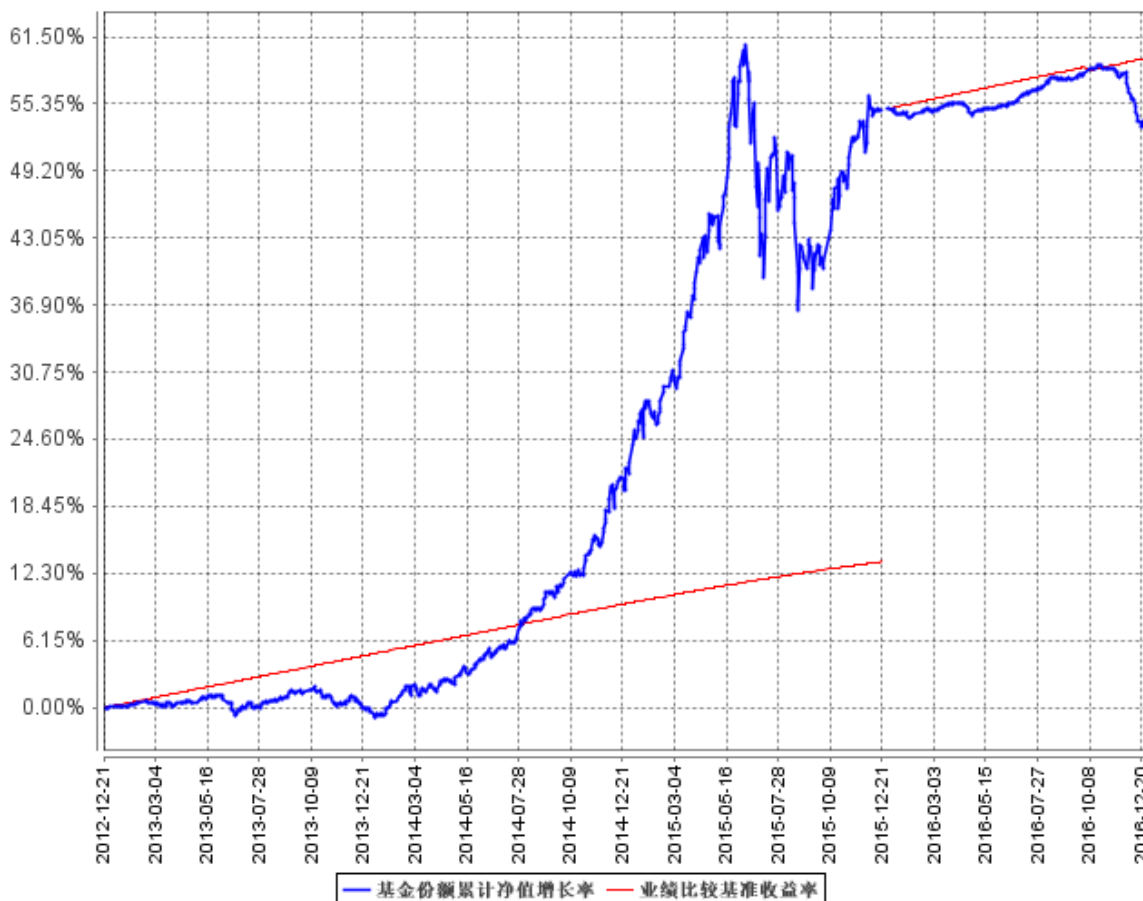
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.35%	0.14%	0.82%	0.01%	-3.17%	0.13%
过去六个月	-0.89%	0.12%	1.65%	0.01%	-2.54%	0.11%
过去一年	-0.30%	0.10%	3.30%	0.01%	-3.60%	0.09%
过去三年	54.80%	0.83%	11.64%	0.01%	43.16%	0.82%
自基金合同生效起至今	54.34%	0.70%	17.10%	0.01%	37.24%	0.69%

注：根据《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》以及《南方安心保本混合型证券投资基金保本到期操作规则及转入下一保本期的相关规则的提示性公告》的相关规定, 本基金的第一个保本期为三年, 自 2012 年 12 月 21 日至 2015 年 12 月 21 日止; 第二个保本期为三年, 自 2015 年 12 月 29 日至 2018 年 12 月 29 日止。

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

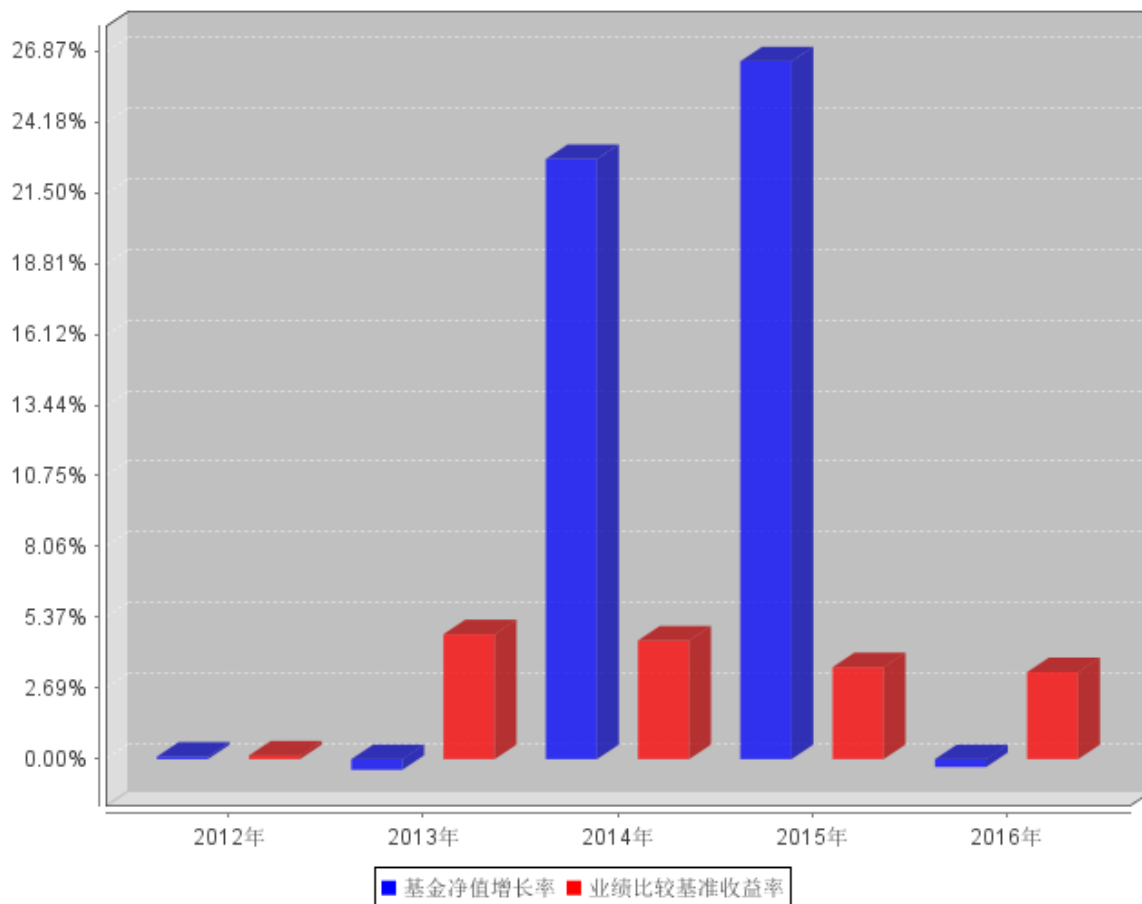
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	-	-	-	-	
2015	5.0000	380,980,962.94	-	380,980,962.94	
2014	-	-	-	-	
合计	5.0000	380,980,962.94	-	380,980,962.94	

## §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		
刘文良	本基金基金经理	2015 年 12 月 30 日	-	4 年	北京大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师；2015 年 2 月至 2015 年 8 月，任南方永利基金经理助理；2015 年 8 月至今，任南方永利基金经理；2015 年 12 月至今，任南方弘利、南方安心基金经理；2016 年 6 月至今，任南方广利基金经理；2016 年 7 月至今，任南方甄智混合基金经理；2016 年 11 月至今，任南方荣发、南方卓元基金经理。
卢玉珊	本基金	2015 年	-	8 年	女，清华大学会计学硕士，具有基金从业



	基金经 理	12 月 30 日			资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作；2015 年 2 月至 2015 年 12 月，任南方成份、南方安心的基金经理助理；2015 年 5 月至 2015 年 12 月，任南方改革机遇的基金经理助理；2015 年 12 月至今，任南方安心基金经理。
陈键	本基金 基金经 理	2012 年 12 月 21 日	2016 年 1 月 26 日	16 年	硕士学历，具有基金从业资格。2000 年加入南方基金，历任行业研究员、基金经理助理、投资部执行总监，2014 年 12 月至今，担任投资部总监。2003 年 11 月-2005 年 6 月，任南方宝元基金经理；2004 年 3 月-2005 年 3 月，任南方现金基金经理；2005 年 3 月-2006 年 3 月，任南方积配基金经理；2008 年 2 月至 2010 年 10 月，任南方盛元基金经理；2006 年 3 月至 2014 年 7 月，任天元基金经理；2010 年 10 月至 2016 年 1 月，任南方成份基金经理；2012 年 12 月至 2016 年 1 月，任南方安心基金经理；2015 年 5 月至 2016 年 1 月，任南方改革机遇基金经理。

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《南方安心保本混合型证券投资基金合同》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

安全资产方面，上半年在保本期初期控制了建仓节奏，以信用债为主，保持组合久期在较短

水平，主要获取票息收益，较好地规避了 4 月份债券市场的调整，截止年中累积了一定的安全垫，三季度在严格控制信用风险的前提下，在一二级市场上精选性价比较高的债券加以配置，提高了组合杠杆，同时综合考虑基本面、货币政策、市场情绪等因素，择机参与了利率债行情，获取了一定的价差收益，四季度信用债以持有为主，在 11、12 月债券市场大幅调整过程中卖出利率债，快速降低组合久期和杠杆，但是市场调整的速度和幅度超出预期，对组合净值造成了一定的负面影响，在年底资金面紧张的时点布局了部分逆回购资产。

风险资产方面，由于年初股票市场遭遇“熔断”，使得安全垫的累积变得较为缓慢，前三季度随着净值的增长我们逐渐增加了风险资产的配置，但 11 月底开始债券收益率大幅上行，净值回撤较多，我们又再次下调了风险资产的仓位。随着债券市场风险的逐步释放，我们会逐步增加风险资产的配置比例。

在行业配置和个股选择策略上，我们沿着安全低估值蓝筹和估值合理的成长股两条主线展开，对供给端调整充分、景气度持续提升的部分周期性品种也进行了配置。个股选择上注重安全边际，控制回撤风险，以相对估值水平、重估价值、价格安全锚（例如员工持股价、高管增持价、定增价格）等综合角度判断股票的安全边际，严格控制个股的下行风险。

2016 年四季度经济增长数据企稳回升，补库存周期仍在持续，预计 2017 年一季度经济数据仍比较平稳，需要观察房地产调控对经济的拖累作用是否会陆续显现出来，PPI 同比增速继续上冲，CPI 同比春节后将有所下降，此后陆续上行，中央经济工作会议定调货币政策保持稳健中性，调节好货币闸门，把防控金融风险放到更加重要的位置，着力防控资产泡沫，预计一季度流动性环境较去年四季度难有改善。综合来看，一季度的基本面和政策组合仍对债券市场形成压制，但年初配置力量相对较强，市场表现应好于去年四季度，预计整体呈现弱势震荡格局，收益率曲线较为平坦的状态下，中短端品种的性价比较高。南方安心将坚持稳健操作原则，主要获取信用债持有收益，在严格控制信用风险的前提下重点关注中短端品种，根据资金面的变化灵活调整组合的杠杆水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年，本基金净值增长率为-0.30%，业绩基准为 3.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前时点股票在各大类资产相比较之下属于性价比较高的品种，养老金、保险资金的逐步入市是长期趋势，风险偏好较低的资金占比持续提高会带来市场风格的转变。伴随着 IPO 加速，以及过去两年中小创大量的并购，到现在包括业绩承诺能否兑现，以及商誉减值等都抑制风险偏好的释放，市场风格切换到企业盈利的确定性和是否超预期上，我们在股票投资上将继续秉承稳健投资、着眼中长期投资增值的思路，投资于业绩趋势稳定向上、同时估值合理的标的上，适当把握新兴产业、消费、医疗行业中可能出现的投资机会，综合运用新股申购、定增等手段提升整体收益率。

#### 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。

#### 4.7 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，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；保本周期内，本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资。转型为“南方核心竞争混合型证券投资基金”后，基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §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 21480 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:南方安心保本混合型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	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	16,970,481.27	231,739,230.40
结算备付金	66,533,079.34	923,681.88
存出保证金	171,410.57	386,840.03
交易性金融资产	3,202,864,282.12	43,163,992.80
其中:股票投资	118,227,423.82	36,072,992.80
基金投资	-	-
债券投资	3,084,636,858.30	7,091,000.00
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	531,176,116.77	2,663,900,000.00
应收证券清算款	-	1,065,583,509.50
应收利息	62,624,029.05	311,198.27
应收股利	-	-
应收申购款	-	-

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,880,339,399.12	4,006,008,452.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>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	42,000,000.00	-
应付证券清算款	252,956.95	19,902,394.22
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,404,873.98	1,162,525.37
应付托管费	652,573.89	172,225.98
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	411,961.20	835,625.32
应交税费	-	-
应付利息	840.00	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	400,000.00	191,000.00
负债合计	48,123,206.02	22,263,770.89
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	3,666,045,067.74	3,798,925,879.54
未分配利润	166,171,125.36	184,818,802.45
所有者权益合计	3,832,216,193.10	3,983,744,681.99
负债和所有者权益总计	3,880,339,399.12	4,006,008,452.88

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.997 元，基金份额总额

3,844,305,818.73 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方安心保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	71,874,221.58	377,369,075.82
1. 利息收入	143,265,596.25	58,438,134.31
其中：存款利息收入	1,266,219.09	984,163.08
债券利息收入	134,518,255.48	55,370,483.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,481,121.68	2,083,488.04
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-33,489,573.54	412,347,463.10
其中：股票投资收益	28,753,882.09	346,878,046.41
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-62,994,343.52	59,134,090.70
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	750,887.89	6,335,325.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-39,000,389.77	-96,797,365.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,098,588.64	3,380,843.53
<b>减：二、费用</b>	82,484,195.82	36,966,975.06



1. 管理人报酬	53,494,306.77	17,992,792.68
2. 托管费	7,925,082.46	2,665,598.91
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,055,687.59	6,519,767.79
5. 利息支出	18,513,986.92	9,308,001.29
其中：卖出回购金融资产支出	18,513,986.92	9,308,001.29
6. 其他费用	495,132.08	480,814.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-10,609,974.24	340,402,100.76
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-10,609,974.24	340,402,100.76

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方安心保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,798,925,879.54	184,818,802.45	3,983,744,681.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,609,974.24	-10,609,974.24
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）	-132,880,811.80	-8,037,702.85	-140,918,514.65

列)			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-132,880,811.80	-8,037,702.85	-140,918,514.65
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）	3,666,045,067.74	166,171,125.36	3,832,216,193.10
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,236,499,793.13	276,712,456.07	1,513,212,249.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	340,402,100.76	340,402,100.76
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）	2,562,426,086.41	-51,314,791.44	2,511,111,294.97
其中：1. 基金申购款	3,413,908,175.16	165,992,578.75	3,579,900,753.91
2. 基金赎回款	-851,482,088.75	-217,307,370.19	-1,068,789,458.94
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）	-	-380,980,962.94	-380,980,962.94
五、期末所有者权益（基	3,798,925,879.54	184,818,802.45	3,983,744,681.99

金净值)			
------	--	--	--

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

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完全一致。

### 7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.2.1 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。

#### 7.4.2.2 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。

#### 7.4.2.3 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。

### 7.4.3 税项

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

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券

的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

#### 7.4.4 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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。

## 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华泰证券	599,374,985.67	45.19%	247,503,968.29	6.13%

#### 7.4.5.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
华泰证券	116,356,600.42	9.93%	407,000,381.75	80.25%

#### 7.4.5.1.3 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。

#### 7.4.5.1.4 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
华泰证券	548,581.12	45.06%	338,904.66	94.30%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	218,599.24	6.00%	-417.74	-0.05%

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。

## 7.4.5.2 关联方报酬

### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	53,494,306.77	17,992,792.68
其中：支付销售机构的客户维护费	8,089,458.69	5,731,109.32

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 1.35% 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 1.35% / 当年天数。

### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,925,082.46	2,665,598.91

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

## 7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	61,836,615.41	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	-	-

## 7.4.5.4 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。

## 7.4.5.5 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
	招商银行	16,970,481.27	533,354.65	231,739,230.40

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

## 7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日	

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
兴业证券	113010	江南转债	网下申购	5,500	550,000.00
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
兴业证券	-	-	-	-	-

#### 7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

#### 7.4.6 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	新股流通受限	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	新股流通受限	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	新股流通受限	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	新股流通 受限	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	新股流通 受限	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	新股流通 受限	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	新股流通 受限	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	新股流通 受限	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	新股流通 受限	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	新股流通 受限	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	新股流通 受限	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	新股流通 受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年 12月	2017年 1月10日	新股流通 受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

		30 日								
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通 受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.6.2 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
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	重大资产重组	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	400,000	2,567,793.00	2,772,000.00	-
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	重大资产重组	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	79,978	1,991,301.42	2,074,629.32	-
002635	安洁科技	2016 年 11 月 8 日	重大资产重组	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	50,000	1,681,544.00	1,820,000.00	-
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	重大事项未公告	19.70	2017 年 2 月 21 日	18.35	72,900	1,445,553.52	1,436,130.00	-
603555	贵人鸟	2016 年 12 月 12 日	重大资产重组	30.76	-	-	40,000	1,027,200.00	1,230,400.00	-

300100	双林股份	2016 年 11 月 7 日	重大资 产重组	34.00	2017 年 1 月 25 日	30.60	34,500	1,191,980.00	1,173,000.00	-
--------	------	--------------------	------------	-------	-----------------------	-------	--------	--------------	--------------	---

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 42,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.7 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 109,107,670.80 元，属于第二层次的余额为 3,093,756,611.32 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 36,066,088.50 元，第二层次 7,097,904.30 元，无第三层次)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	118,227,423.82	3.05
	其中：股票	118,227,423.82	3.05
2	固定收益投资	3,084,636,858.30	79.49
	其中：债券	3,084,636,858.30	79.49

	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	531,176,116.77	13.69
	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	83,503,560.61	2.15
7	其他各项资产	62,795,439.62	1.62
8	合计	3,880,339,399.12	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	59,595,738.78	1.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,458,917.66	0.04
E	建筑业	20,209,701.64	0.53
F	批发和零售业	7,095,764.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,503,122.87	0.04
J	金融业	14,603,306.91	0.38
K	房地产业	6,104,713.28	0.16
L	租赁和商务服务业	3,300,700.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,346,000.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	118,227,423.82	3.09

### 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	002325	洪涛股份	1,250,641	10,017,634.41	0.26
2	300309	吉艾科技	300,000	7,068,000.00	0.18
3	002217	合力泰	350,000	6,265,000.00	0.16
4	601166	兴业银行	300,000	4,842,000.00	0.13
5	600567	山鹰纸业	1,200,002	4,344,007.24	0.11
6	000651	格力电器	160,000	3,939,200.00	0.10
7	002494	华斯股份	282,400	3,908,416.00	0.10
8	600511	国药股份	120,000	3,612,000.00	0.09
9	600643	爱建集团	273,451	3,393,526.91	0.09
10	600519	贵州茅台	10,000	3,341,500.00	0.09

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	000018	神州长城	25,439,263.61	0.64
2	002325	洪涛股份	12,466,674.28	0.31
3	601566	九牧王	12,138,103.27	0.30
4	002397	梦洁股份	9,952,602.87	0.25
5	000978	桂林旅游	9,713,385.11	0.24
6	002081	金螳螂	7,528,324.00	0.19
7	002029	七匹狼	7,382,970.00	0.19
8	600015	华夏银行	7,312,426.00	0.18
9	600155	宝硕股份	7,150,175.40	0.18
10	600297	广汇汽车	7,142,833.50	0.18
11	300309	吉艾科技	6,710,984.00	0.17
12	300120	经纬电材	6,568,730.00	0.16
13	600209	罗顿发展	6,365,531.00	0.16
14	002016	世荣兆业	6,285,140.00	0.16
15	002217	合力泰	5,981,255.00	0.15
16	002494	华斯股份	5,880,763.70	0.15
17	002200	云投生态	5,166,543.09	0.13
18	601166	兴业银行	4,701,441.00	0.12
19	600068	葛洲坝	4,357,750.00	0.11
20	002293	罗莱生活	3,985,042.60	0.10

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	000018	神州长城	25,770,834.37	0.65
2	601566	九牧王	12,741,473.21	0.32

3	002397	梦洁股份	9,997,116.00	0.25
4	300120	经纬电材	9,511,566.00	0.24
5	000978	桂林旅游	8,333,712.00	0.21
6	600155	宝硕股份	7,565,901.26	0.19
7	600297	广汇汽车	7,500,564.00	0.19
8	600209	罗顿发展	6,860,532.00	0.17
9	601616	广电电气	6,005,046.00	0.15
10	002665	首航节能	5,596,722.50	0.14
11	002200	云投生态	5,459,637.00	0.14
12	002016	世荣兆业	5,117,554.02	0.13
13	000418	小天鹅A	4,664,298.00	0.12
14	002029	七匹狼	4,554,014.00	0.11
15	600015	华夏银行	4,495,506.00	0.11
16	601021	春秋航空	4,339,721.00	0.11
17	002293	罗莱生活	4,226,488.90	0.11
18	002081	金螳螂	4,210,439.50	0.11
19	002683	宏大爆破	4,169,692.59	0.10
20	600794	保税科技	4,019,324.00	0.10

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	693,171,740.33
卖出股票收入（成交）总额	642,134,266.67

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元



序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	189,871,000.00	4.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	839,499,000.00	21.91
5	企业短期融资券	921,595,000.00	24.05
6	中期票据	1,129,361,000.00	29.47
7	可转债（可交换债）	4,310,858.30	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,084,636,858.30	80.49

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	136176	16 绿地 01	2,000,000	194,000,000.00	5.06
2	019539	16 国债 11	900,000	89,883,000.00	2.35
3	041654030	16 河钢 CP003	800,000	80,176,000.00	2.09
4	041664020	16 张家公资 CP001	800,000	80,048,000.00	2.09
5	101654039	16 中建 MTN001	800,000	79,344,000.00	2.07

### 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投资。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	171,410.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	62,624,029.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	62,795,439.62
---	----	---------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128011	汽模转债	1,168,337.70	0.03
2	127003	海印转债	1,124,388.60	0.03
3	113010	江南转债	627,000.00	0.02

#### 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
17,759	216,470.85	1,870,956,980.27	48.67%	1,973,348,838.46	51.33%

### 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	4,350.85	0.0001%

**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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2012年12月21日）基金份额总额	2,415,677,623.31
本报告期期初基金份额总额	3,983,638,962.28
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	139,333,143.55
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	3,844,305,818.73

**§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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 100,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 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	
华泰证券	2	599,374,985.67	45.19%	548,581.12	45.06%	-
广发证券	1	352,696,471.90	26.59%	321,411.87	26.40%	-
银河证券	1	197,669,155.79	14.90%	183,757.43	15.09%	-
中投证券	1	120,347,954.19	9.07%	111,529.55	9.16%	-
国信证券	1	56,326,164.34	4.25%	52,274.83	4.29%	-

华创证券	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
华泰证券	116,356,600.42	9.93%	22,116,000,000.00	22.39%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	329,013,952.85	28.07%	34,447,000,000.00	34.88%	-	-
中投证券	546,628,896.71	46.63%	28,156,000,000.00	28.51%	-	-
国信证券	180,299,087.50	15.38%	14,041,000,000.00	14.22%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

