

# 南方恒元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：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	南方恒元保本混合
基金主代码	202211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 11 月 12 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	409,955,114.21 份

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“南方恒元”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，为投资者提供认购保本金额/申购保本金额的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略分为两个层次：一层为对风险资产和无风险资产的配置，该层次以恒定比例组合保险策略为依据，即风险资产部分所能承受的损失最大不能超过无风险资产部分所产生的收益；另一层为对风险资产部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略进行调整。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款税后收益率
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	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 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
--------------------	---

址	
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	15,471,172.03	123,667,372.36	170,054,221.59
本期利润	14,400,539.89	127,712,504.27	179,862,301.69
加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.2411	0.0986
本期基金份额净值增长率	3.37%	22.28%	9.51%
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	0.2208	0.2302	0.0073
期末基金资产净值	497,824,245.39	549,426,276.83	636,390,603.10
期末基金份额净值	1.214	1.224	1.001

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、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

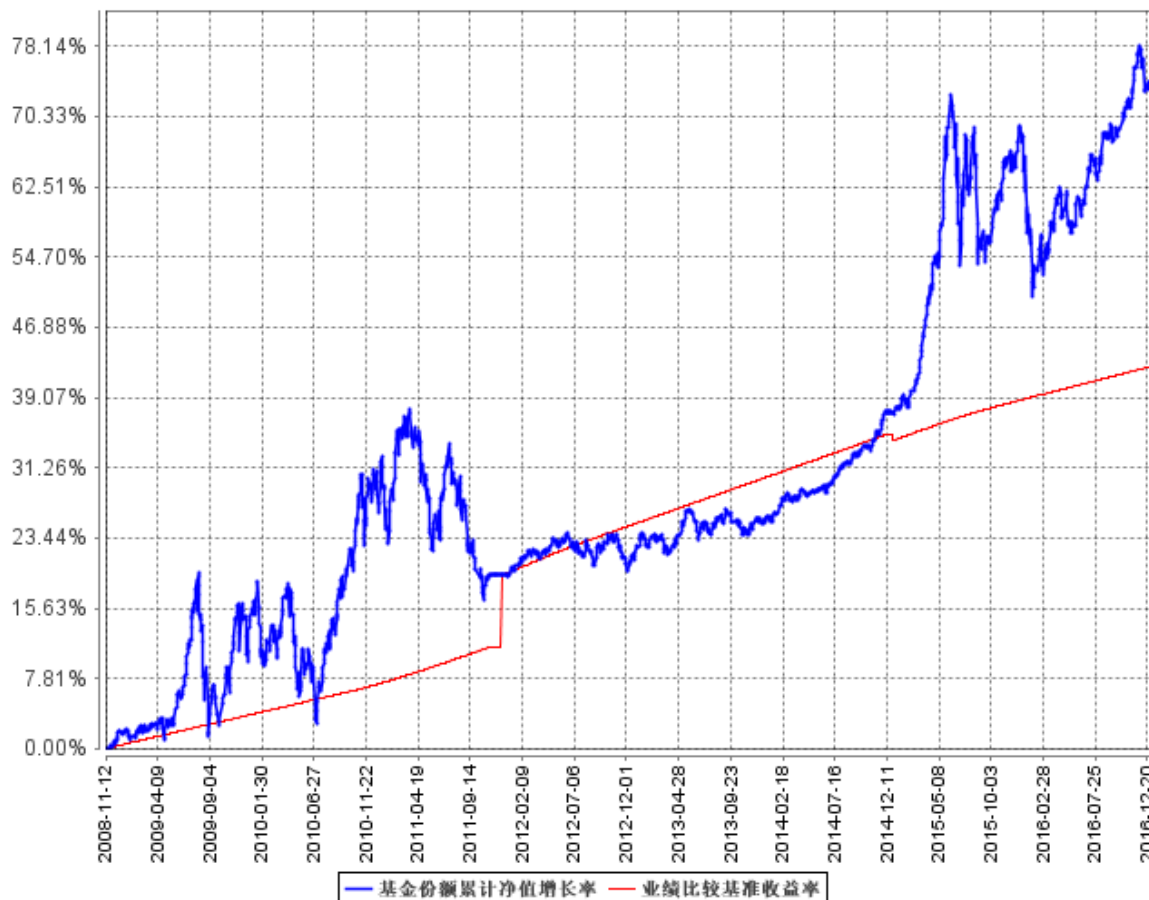
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.88%	0.38%	0.66%	0.01%	2.22%	0.37%
过去六个月	6.96%	0.37%	1.32%	0.01%	5.64%	0.36%
过去一年	3.37%	0.59%	2.67%	0.01%	0.70%	0.58%
过去三年	38.43%	0.54%	9.50%	0.02%	28.93%	0.52%
过去五年	45.64%	0.44%	19.18%	0.02%	26.46%	0.42%
自基金合同生效起至今	73.84%	0.62%	42.55%	0.16%	31.29%	0.46%

##### 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

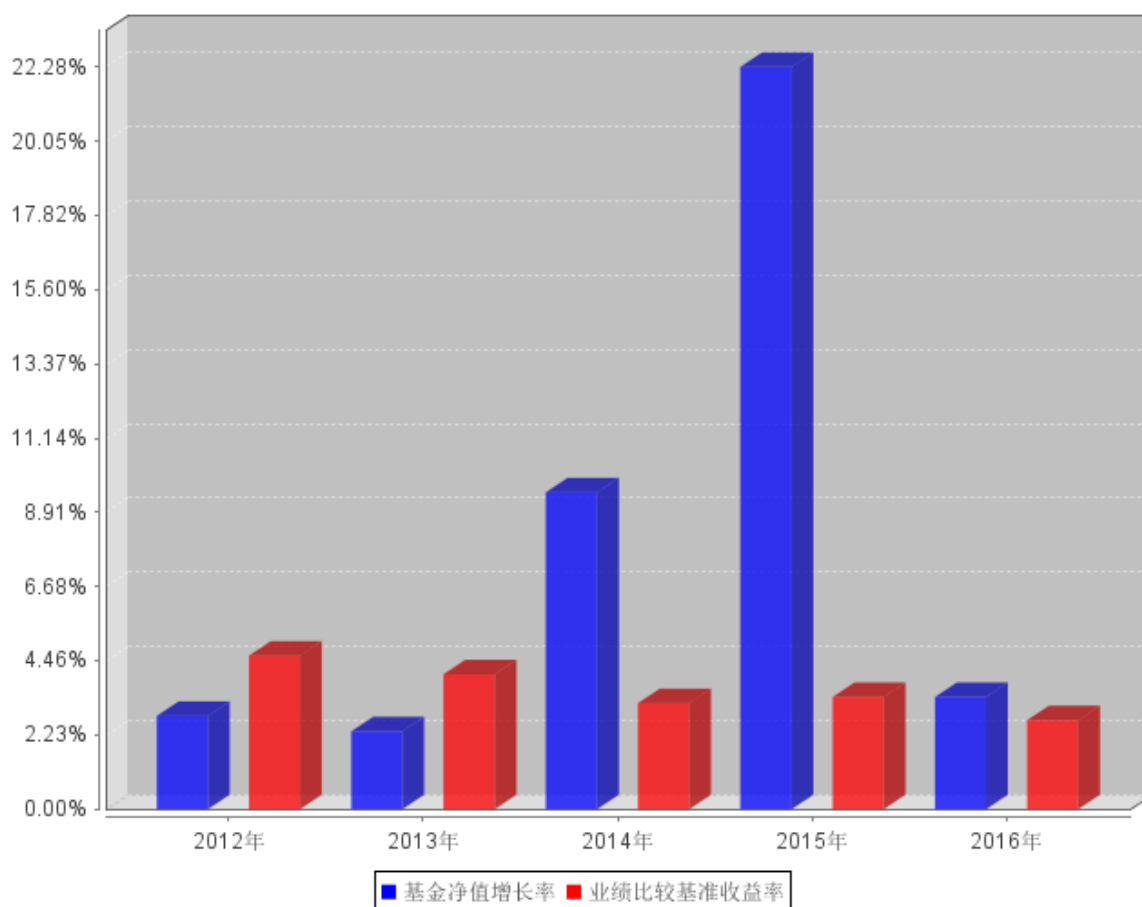
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的第一个保本期为三年，自 2008 年 11 月 12 日至 2011 年 11 月 14 日止，第一个保本期的净值增长率为 19.34%；第二个保本期为三年，自 2011 年 12 月 13 日至 2014 年 12 月 15 日止，第二个保本期的净值增长率为 15.18%。第三个保本期为三年，自 2014 年 12 月 30 日至 2017 年 12 月 30 日止。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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

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	0.4700	20,901,266.32	-	20,901,266.32	
2015	-	-	-	-	
2014	1.3800	229,126,098.59	-	229,126,098.59	
合计	1.8500	250,027,364.91	-	250,027,364.91	

## § 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		
吴剑毅	本基金基金经理	2014 年 7 月 18 日	-	8 年	清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；2012 年 3 月至 2014 年 7 月，担任南方避险、南方保本基金经理助理；2014 年 7 月至今，任南方恒元基金经理；2015 年 5 月至今，任南方利众基金经理；2015 年 7 月至今，任南方利达基金经理；2015 年 9 月至今，任南方消费活力基金经理；2015 年 10 月至今，任南方顺达基金经理；2015 年 11 月至今，任南方利安、南方顺康基金经理；2016 年 12 月至今，任南方安颐养老基金经理。
姚万宁	本基金基金经理助理	2015 年 11 月 23 日	-	4 年	深圳大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，担任投资部投资账户助理；2015 年 11 月至今，任南方恒

					元、南方利众、南方利达、南方利安、南方顺达、南方顺康的基金经理助理； 2016 年 12 月至今，任南方安颐养老基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。



公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年, 国内经济呈现复苏态势, GDP 同比增长 6.7%, 规模以上工业增加值同比增长 6%, 社会消费品零售总额同比增长 10.4%, CPI 同比上涨 2%。数据显示通胀温和可控, 消费需求有回暖迹象。PMI 自 8 月重返荣枯线水平之上后逐渐回升, 并在 11 月攀升至 51.7, 创下 28 个月以来新高, 虽然在 12 月小幅回落至 51.4, 但仍处于扩张区间, 且生产、需求较旺。而 PPI 也呈加速回升态势, 全年同比下降 1.4%, 但 12 月大幅提升至 5.5%, 有利于工业企业盈利企稳回升。PMI 和工业企业数据均表明当前库存处于偏低位置, 叠加 PPI 持续回升, 进一步去库存压力较小, 补库存反而很有动力, 是支持经济增长的重要因素, 而 PPP 在城市基础建设管理方面空间广阔, 将成为新的经济拉动点。同时全球主要国家和地区 PMI 总体改善, 有助于提振国内出口和制造业投资, 弥补地产投资可能的下滑。

市场方面, 股票市场在经过年初大幅调整后维持区间震荡行情, 结构上分化显著: 全年上证综指下跌 12.31%, 创业板指下跌 27.71%; 债券市场在 10 月创出新高后于 12 月出现剧烈调整, 全年中证全债指数上涨 2%。

报告期内, 本基金遵循 CPPI 保本策略, 在控制好回撤风险的前提下确定股票仓位上限, 股票仓位重点配置于价格低于合理价值的个股并持有等待价值回归。由于当前安全垫水平较高, 具备较强的回撤容忍度, 因此我们保持了相对较高的股票仓位, 以追求获取更高的收益回报。固定收益投资方面, 本基金在券种的选择仍然以高评级、短久期为主, 主要目的是获取确定性的持有到期收益, 同时也较好地抵御了 12 月份债市的调整。去年下半年开始, 新股发行节奏保持在一个相对较快的水平, 也为我们贡献了确定性的绝对回报。

#### 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 1.214 元，本报告期份额净值增长率为 3.37%，同期业绩比较基准增长率为 2.67%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央经济工作会议明确 2017 年的总基调是稳中求进，并将经济工作重点转向防风险与深化改革。从消费、投资与外贸三方面来看，2017 年经济下行压力依然存在。尽管经济面临压力，货币政策空间也不大，更多依赖财政刺激，但流动性宽松和无风险利率走低的背景并未发生变化，低风险资金持续流入股市的步伐也没有改变，未来随着这一进程的持续，将为二级市场带来增量的低风险资金。我们认为 2017 年股票市场依然存在着众多的绝对收益机会，在股票的配置上将继续立足于选取价格具备收敛机制、可以越跌越买的品种。当前主要从如下 3 个方面的收敛机制选股：（1）PEG 小于 1 的白马成长股；（2）市值低于重估价值，存在被举牌的可能；（3）价格低于定增价或重要股东增持成本。本保本周期预计于 17 年底到期，由于当前产品安全垫较高，具备较强的抗风险能力，股票仓位相对较高，但 2017 年 2 月 10 日证监会发布《关于避险策略基金的指导意见》，要求避险策略基金投资于稳健资产的比例不得低于基金资产净值的 80%，我们将根据指导意见相应增加稳健资产的配置比例，适当降低股票仓位，并通过选股努力获取绝对收益。

债市方面，随着 17 年开年以来债市的进一步调整，当前中美两国 10 年期国债收益率价差已恢复到合理水平。尽管短期内并未看到支撑债市收益率下行的有利条件，但是当前长端利率债已经具备一定的配置价值。在组合整体固收资产配置以获取持有到期收益为主的前提下，我们将结合市场环境适当增加对于长端利率债的配置，同时将此部分配置视为风险资产的一部分，同股票资产一起纳入回撤控制目标的考虑范畴。

#### 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,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 6 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；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；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，本基金于 2017 年 1 月 19 日进行了本基金的 2016 年年度收益分配（每 10 份基金份额合计派 0.45 元）。

本报告期内 2016 年 1 月 20 日已分配数（每 10 份基金份额合计派 0.47 元）为以往年度收益分配。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无。

#### **4.10 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恒元保本混合型证券投资基金的托管过程中，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，南方恒元保本混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方恒元保本混合型证券投资基金的投资运作、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，南方恒元保本混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 20,901,266.32 元。

## 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恒元保本混合型证券投资基金 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 21466 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：南方恒元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	148,342,423.18	4,651,743.77
结算备付金	815,701.01	3,771,338.89
存出保证金	89,367.94	200,525.96
交易性金融资产	365,585,674.41	614,462,931.62
其中：股票投资	247,561,155.51	192,340,893.72
基金投资	-	-
债券投资	118,024,518.90	422,122,037.90
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	5,006,370.64	5,180,142.69
应收利息	2,761,621.59	6,311,027.97
应收股利	-	-
应收申购款	-	-

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	522,601,158.77	634,577,710.90
<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	23,000,000.00	80,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	142,916.84	3,988,441.41
应付管理人报酬	553,067.97	611,037.98
应付托管费	85,087.41	94,005.83
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	626,137.34	241,901.28
应交税费	-	-
应付利息	13,621.12	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	356,082.70	216,047.57
负债合计	24,776,913.38	85,151,434.07
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	407,307,233.52	446,062,771.82
未分配利润	90,517,011.87	103,363,505.01
所有者权益合计	497,824,245.39	549,426,276.83
负债和所有者权益总计	522,601,158.77	634,577,710.90

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.214 元，基金份额总额 407,307,233.52 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方恒元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	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>	24,490,848.58	143,816,918.64
1. 利息收入	12,957,332.23	20,393,708.04
其中：存款利息收入	1,548,986.22	523,309.05

债券利息收入	11,352,235.00	17,326,171.20
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	56,111.01	2,544,227.79
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	12,438,439.40	118,253,493.64
其中：股票投资收益	11,680,747.98	114,610,755.56
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,510,608.59	1,770,870.19
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	2,268,300.01	1,871,867.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,070,632.14	4,045,131.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	165,709.09	1,124,585.05
<b>减：二、费用</b>	<b>10,090,308.69</b>	<b>16,104,414.37</b>
1. 管理人报酬	6,413,877.41	7,791,607.12
2. 托管费	986,750.37	1,198,708.79
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,388,280.09	3,813,191.06
5. 利息支出	906,742.82	2,911,678.40
其中：卖出回购金融资产支出	906,742.82	2,911,678.40
6. 其他费用	394,658.00	389,229.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>14,400,539.89</b>	<b>127,712,504.27</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>14,400,539.89</b>	<b>127,712,504.27</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方恒元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）	446,062,771.82	103,363,505.01	549,426,276.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	14,400,539.89	14,400,539.89
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）	-38,755,538.30	-6,345,766.71	-45,101,305.01
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-38,755,538.30	-6,345,766.71	-45,101,305.01
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）	-	-20,901,266.32	-20,901,266.32
五、期末所有者权益（基金净值）	407,307,233.52	90,517,011.87	497,824,245.39
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）	631,732,143.36	4,658,459.74	636,390,603.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	127,712,504.27	127,712,504.27
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）	-185,669,371.54	-29,007,459.00	-214,676,830.54
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-185,669,371.54	-29,007,459.00	-214,676,830.54
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）	446,062,771.82	103,363,505.01	549,426,276.83

注：报表附注为财务报表的组成部分。



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) 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。

### 7.4.3 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
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 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
兴业证券	-	-	5,815,210.15	0.23%

##### 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

兴业证券	-	-	-	-
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 (%)
兴业证券	5,145.87	0.23%	-	-

注：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1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,413,877.41	7,791,607.12
其中：支付销售机构的客户维护费	1,042,082.56	1,324,553.73

注：支付基金管理人南方基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.3% 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 1.3% / 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2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	986,750.37	1,198,708.79

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 0.2% 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 0.2% / 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

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
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
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
中国工商银行	41,290,353.66	-	-	-	-	-

#### 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 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	3,342,423.18	59,318.74	4,651,743.77	423,108.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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 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

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 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
002792	通宇通讯	2016 年 3 月 21 日	2017 年 3 月 28 日	新股流通受限	22.94	54.26	71,756	1,646,082.64	3,893,480.56	-

002821	凯莱英	2016年 11月 11日	2017年 11月 18日	新股流 通受限	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-
002792	通宇 通讯	2016年 3月 21日	2017年 3月 28日	新股流 通受限	-	54.26	35,878	-	1,946,740.28	-
300508	维宏 股份	2016年 4月 12日	2017年 4月 19日	新股流 通受限	20.08	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-
603823	百合 花	2016年 12月 9日	2017年 12月 20日	新股流 通受限	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
603660	苏州 科达	2016年 11月 21日	2017年 12月 1日	新股流 通受限	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	-
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	-
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	-
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	2,192	50,766.72	50,766.72	-
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。

#### 7.4.5.2 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

000750	国海 证券	2016 年 12月 15日	重大 事项	6.97	2017 年 1月 20日	6.27	768,633	5,836,779.23	5,357,372.01	-
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	753,600	5,083,728.00	5,222,448.00	-
002400	省广 股份	2016 年 11月 28日	重大 事项	13.79	-	-	374,800	5,069,000.61	5,168,492.00	-
002260	德奥 通航	2016 年 12月 5日	重大 资产 重组	23.10	-	-	132,300	3,273,859.66	3,056,130.00	-
000166	申万 宏源	2016 年 12月 21日	重大 事项	6.25	2017 年 1月 26日	6.29	231,400	1,475,765.00	1,446,250.00	-
603308	应流 股份	2016 年 11月 24日	重大 资产 重组	21.92	2017 年 2月 14日	21.92	13,600	290,340.00	298,112.00	-

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。

### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.5.3.1 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。

#### 7.4.5.3.2 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 23,000,000.00 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。

### 7.4.6 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 216,451,667.79 元，属于第二层次的余额为 149,134,006.62 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 185,980,773.32 元，第二层次 428,482,158.30 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	247,561,155.51	47.37
	其中：股票	247,561,155.51	47.37
2	固定收益投资	118,024,518.90	22.58
	其中：债券	118,024,518.90	22.58
	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	149,158,124.19	28.54
7	其他各项资产	7,857,360.17	1.50
8	合计	522,601,158.77	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,536,332.38	2.72
C	制造业	108,983,792.83	21.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,010,877.66	0.81
E	建筑业	3,833,640.23	0.77
F	批发和零售业	15,575,210.88	3.13
G	交通运输、仓储和邮政业	7,494,761.74	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,014,310.77	4.02
J	金融业	33,746,403.22	6.78
K	房地产业	16,454,673.60	3.31
L	租赁和商务服务业	10,708,047.20	2.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,086,430.00	1.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,116,675.00	0.83
S	综合	-	-
	合计	247,561,155.51	49.73

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

## 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	600015	华夏银行	974,285	10,570,992.25	2.12
2	000069	华侨城 A	1,307,400	9,086,430.00	1.83
3	600600	青岛啤酒	238,589	7,024,060.16	1.41
4	600315	上海家化	221,720	6,010,829.20	1.21
5	600223	鲁商置业	1,088,690	5,922,473.60	1.19
6	002029	七匹狼	575,276	5,873,567.96	1.18
7	002792	通宇通讯	107,634	5,840,220.84	1.17
8	600153	建发股份	541,450	5,793,515.00	1.16
9	002004	华邦健康	630,600	5,719,542.00	1.15
10	002517	恺英网络	165,531	5,555,220.36	1.12

## 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	000540	中天城投	15,332,878.34	2.79
2	600015	华夏银行	12,371,559.00	2.25
3	600223	鲁商置业	11,951,814.25	2.18
4	600739	辽宁成大	11,856,030.76	2.16
5	601939	建设银行	9,921,898.00	1.81

6	000001	平安银行	9,916,484.66	1.80
7	002344	海宁皮城	9,411,629.34	1.71
8	000069	华侨城A	8,049,162.11	1.47
9	002029	七匹狼	7,438,616.46	1.35
10	600096	云天化	6,856,312.96	1.25
11	600325	华发股份	6,670,622.00	1.21
12	002004	华邦健康	6,142,443.00	1.12
13	600315	上海家化	6,118,392.30	1.11
14	000905	厦门港务	6,113,632.51	1.11
15	002517	恺英网络	6,069,809.13	1.10
16	600153	建发股份	6,040,058.45	1.10
17	601628	中国人寿	5,965,678.00	1.09
18	002353	杰瑞股份	5,950,601.44	1.08
19	000589	黔轮胎A	5,913,634.00	1.08
20	600587	新华医疗	5,756,546.73	1.05

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	600739	辽宁成大	13,054,398.85	2.38
2	002251	步步高	13,002,517.65	2.37
3	601988	中国银行	12,569,175.75	2.29
4	601939	建设银行	12,291,534.92	2.24
5	000001	平安银行	10,927,661.14	1.99
6	000540	中天城投	10,356,928.00	1.89
7	000895	双汇发展	10,213,761.04	1.86
8	600005	武钢股份	9,133,321.55	1.66
9	600600	青岛啤酒	8,898,292.81	1.62
10	002353	杰瑞股份	8,716,382.46	1.59
11	600031	三一重工	8,622,684.42	1.57
12	600597	光明乳业	8,339,397.25	1.52
13	000750	国海证券	7,293,777.56	1.33
14	600325	华发股份	6,838,850.00	1.24
15	601166	兴业银行	6,623,638.00	1.21

16	600755	厦门国贸	6,258,625.83	1.14
17	002154	报喜鸟	6,247,985.77	1.14
18	600223	鲁商置业	6,193,373.57	1.13
19	600068	葛洲坝	6,010,915.00	1.09
20	600587	新华医疗	5,856,113.00	1.07

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	491,206,559.94
卖出股票收入（成交）总额	448,252,602.75

注：买入股票成本、卖出股票成本均按照买卖成交金额（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	25,901,600.00	5.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	49,949,065.30	10.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,080,000.00	8.05
7	可转债（可交换债）	2,093,853.60	0.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	118,024,518.90	23.71

## 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	101555023	15 赣高速 MTN004	400,000	40,080,000.00	8.05

2	122199	12 能新 02	240,000	24,264,000.00	4.87
3	019539	16 国债 11	180,000	17,976,600.00	3.61
4	122311	13 海通 04	126,100	12,709,619.00	2.55
5	019533	16 国债 05	79,250	7,925,000.00	1.59

## 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 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。

### 8.12.2

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	89,367.94
2	应收证券清算款	5,006,370.64
3	应收股利	-
4	应收利息	2,761,621.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,857,360.17

**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	110035	白云转债	2,093,853.60	0.42

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,094	-	31,505,251.92	7.69%	378,449,862.29	92.31%

**9.3 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	250,645.30	0.0611%
------------------	------------	---------

#### 9.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	-
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（2008年11月12日）基金份额总额	2,210,560,398.03
本报告期期初基金份额总额	448,963,624.68
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	39,008,510.47
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	409,955,114.21

### § 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 55,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 8 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	
平安证券	2	331,413,645.46	35.60%	306,404.18	35.74%	-
申万宏源	2	165,959,659.85	17.83%	152,391.08	17.77%	-



广州证券	1	112,628,195.88	12.10%	102,638.19	11.97%	-
银河证券	2	95,936,864.57	10.31%	87,427.61	10.20%	-
光大证券	1	61,378,023.13	6.59%	57,142.02	6.66%	-
国信证券	2	60,260,355.01	6.47%	56,115.18	6.54%	-
方正证券	1	43,503,563.22	4.67%	40,513.78	4.73%	-
海通证券	1	37,419,296.83	4.02%	34,100.42	3.98%	-
中银国际	1	14,136,027.42	1.52%	13,164.97	1.54%	-
中金公司	1	8,229,611.46	0.88%	7,499.74	0.87%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	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
平安证券	21,367,597.90	41.28%	3,807,500,000.00	89.77%	-	-
申万宏源	4,930,486.90	9.52%	35,000,000.00	0.83%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	18,929,902.20	36.57%	83,000,000.00	1.96%	-	-
国信证券	6,538,773.50	12.63%	189,000,000.00	4.46%	-	-
方正证券	-	-	127,000,000.00	2.99%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-