

南方策略优化混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	83
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.....	83
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.....	83

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	83
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	83
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	83
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
8.12	投资组合报告附注	83
§9	基金份额持有人信息	85
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	85
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	85
§10	开放式基金份额变动	86
§11	重大事件揭示	87
11.1	基金份额持有人大会决议	87
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	87
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	87
11.4	基金投资策略的改变	87
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	87
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	88
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	88
11.8	其他重大事件	89
§12	备查文件目录	95
12.1	备查文件目录	95
12.2	存放地点	95
12.3	查阅方式	95

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方策略优化混合型证券投资基金
基金简称	南方策略优化混合
基金主代码	202019
前端交易代码	202019
后端交易代码	202020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月30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	940,541,009.46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“南方策略”。

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	本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置策略，基金管理人开发了基于 lack-Litterman 模型的“南方量化行业配置模型”。在行业配置的基础上，进一步使用“南方多因子量化选股模型”，依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分，精选各行业具有超额收益能力或潜力的优势个股，构建本基金的股票组合。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数

风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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	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
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		张海波	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六 号免税商务大厦 31-33 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	96,124,290.63	302,506,084.69	94,043,056.98
本期利润	25,786,183.23	240,933,392.17	217,210,652.65
加权平均基金份额本期利润	0.0568	0.5914	0.3079
本期加权平均净值利润率	3.86%	48.44%	43.34%
本期基金份额净值增长率	5.37%	62.43%	48.40%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	549,732,873.80	112,359,112.58	-131,458,890.12
期末可供分配基金份额利润	0.5845	0.3743	-0.1783
期末基金资产净值	1,495,630,752.69	452,965,216.82	684,795,417.97
期末基金份额净值	1.590	1.509	0.929
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	62.16%	53.90%	-5.25%

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

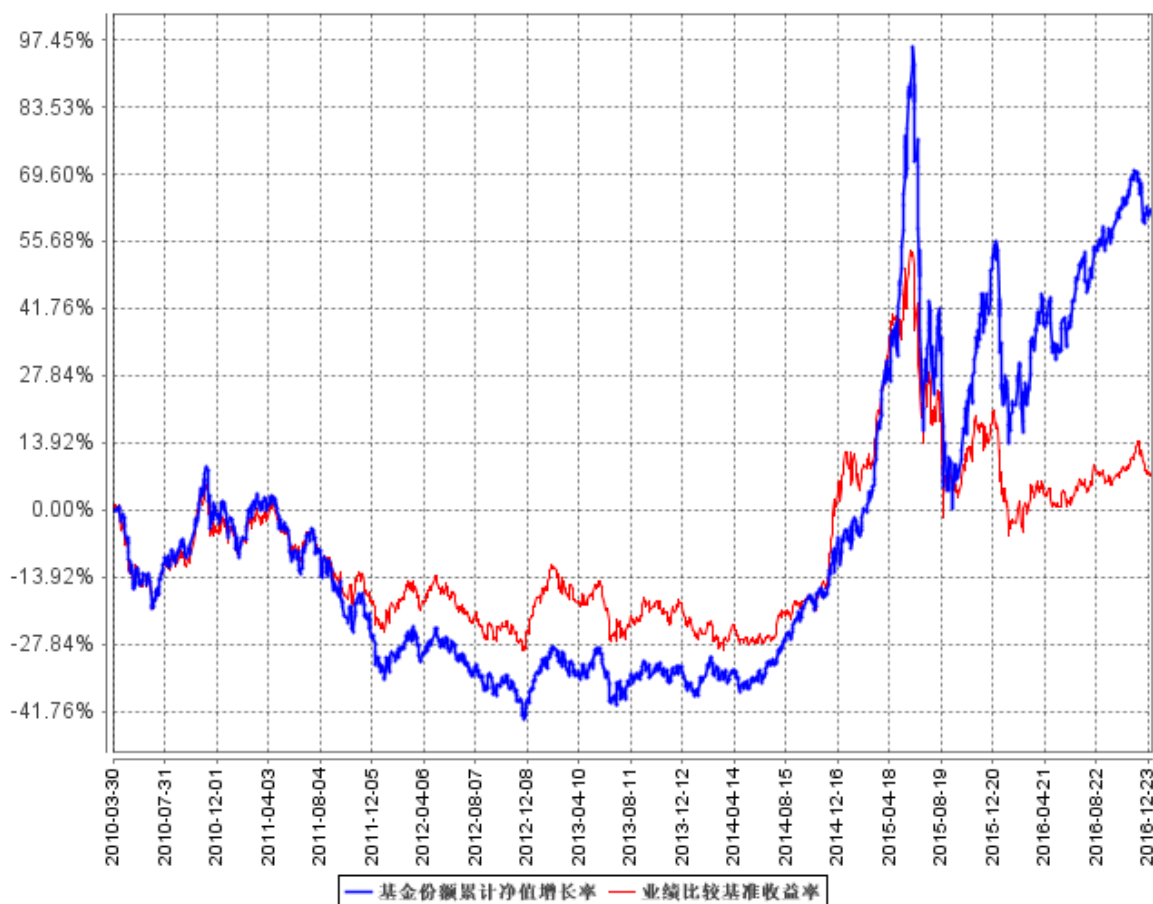
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.71%	0.77%	1.43%	0.57%	1.28%	0.20%

过去六个月	12.85%	0.84%	4.28%	0.61%	8.57%	0.23%
过去一年	5.37%	1.68%	-8.16%	1.12%	13.53%	0.56%
过去三年	153.99%	1.83%	38.69%	1.43%	115.30%	0.40%
过去五年	139.82%	1.63%	40.58%	1.30%	99.24%	0.33%
自基金合同 生效起至今	62.16%	1.56%	7.49%	1.27%	54.67%	0.29%

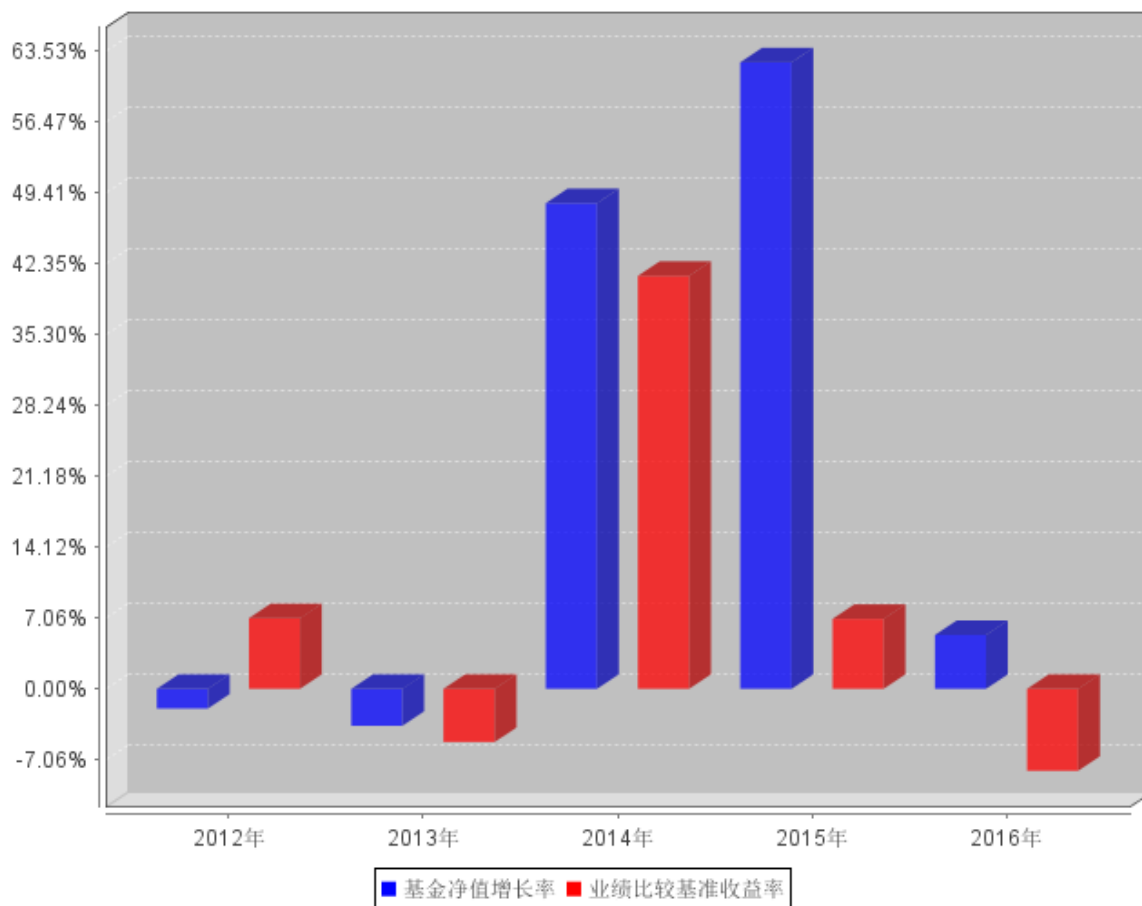
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

注：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		
雷俊	本基 金基 金经 理	2015 年 6 月 16 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。
杨德龙	本基金基金经理	2013年 3月15日	2016年 3月4日	10年	北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师；2010年8月至2013年4月，任小康ETF及南方小康基金经理；2011年9月至2016年3月，任南方上证380ETF及联接基金基金经理；2013年3月至2016年3月，任南方策略基金经理；2013年4月至2016年3月，任南方300基金经理；2013年4月至2016年3月，任南方开元沪深300ETF基金经理；2014年12月至2016年3月，任南方恒生ETF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《南方策略优化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

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。

报告期内本基金采用量化多因子模型选股，重点集中在具有相对优势的价值和成长股之间进行投资。本基金充分发挥量化选股的优势，运用多个量化策略投资，分散投资风险和平衡风险暴露，行业涨跌波动剧烈时在同类基金产品中表现稳健，后续产品运作仍将以量化策略为主，力争获取超越市场表现。

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1.590元，报告期内，份额净值增长率为5.37%，同期业绩基准增长率为-8.16%。

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，本基金的收益分配原则为：本基金收益分配应遵循下列原则：每一基金份额享有同等分配权；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；.基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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，本报告期未有收益分配事项。

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，本基金托管人在对南方策略优化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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21463 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方策略优化混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的南方策略优化混合型证券投资基金(以下简称“南方策略优化基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>一、管理层对财务报表的责任</p> <p>编制和公允列报财务报表是南方策略优化基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>二、注册会计师的责任</p> <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p>

	<p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>三、审计意见</p> <p>我们认为，上述南方策略优化基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了南方策略优化基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	薛 竞	陈 熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 · 上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方策略优化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	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	135,093,667.58	50,937,223.20
结算备付金		7,223,244.41	1,268,641.46
存出保证金		313,302.15	174,806.74
交易性金融资产	7.4.7.2	1,359,791,002.84	400,981,001.22
其中：股票投资		1,359,791,002.84	400,981,001.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	50,000,000.00	-
应收证券清算款		-	1,656,947.62
应收利息	7.4.7.5	27,060.15	10,949.21
应收股利		-	-
应收申购款		3,199,039.69	4,176,860.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,555,647,316.82	459,206,430.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		50,000,000.00	-
应付赎回款		4,720,940.07	1,798,295.30
应付管理人报酬		1,881,203.72	537,210.43
应付托管费		313,533.96	89,535.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,726,995.07	3,458,858.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	373,891.31	357,314.57
负债合计		60,016,564.13	6,241,213.52
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	940,541,009.46	300,223,083.71
未分配利润	7.4.7.10	555,089,743.23	152,742,133.11
所有者权益合计		1,495,630,752.69	452,965,216.82
负债和所有者权益总计		1,555,647,316.82	459,206,430.34

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.590 元，基金份额总额 940,541,009.46 份。

7.2 利润表

会计主体：南方策略优化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	附注号	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
一、收入		46,251,479.01	258,273,086.17
1. 利息收入		649,307.42	642,651.10
其中：存款利息收入	7.4.7.11	517,842.53	370,996.99
债券利息收入		0.88	1,022.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		131,464.01	270,631.59
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		115,459,504.43	318,518,080.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	111,980,476.58	315,176,274.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,990.32	418,087.15
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	3,477,037.53	2,923,718.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-70,338,107.40	-61,572,692.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	480,774.56	685,047.16
减：二、费用		20,465,295.78	17,339,694.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,848,289.21	7,450,007.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,641,381.44	1,241,668.09
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	8,599,273.06	8,268,082.73

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	376,352.07	379,935.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,786,183.23	240,933,392.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,786,183.23	240,933,392.17

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方策略优化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）	300,223,083.71	152,742,133.11	452,965,216.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,786,183.23	25,786,183.23
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）	640,317,925.75	376,561,426.89	1,016,879,352.64
其中：1. 基金申购款	924,317,325.34	522,321,527.69	1,446,638,853.03
2. 基金赎回款	-283,999,399.59	-145,760,100.80	-429,759,500.39
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）	940,541,009.46	555,089,743.23	1,495,630,752.69
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）	737,168,481.26	-52,373,063.29	684,795,417.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	240,933,392.17	240,933,392.17
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）	-436,945,397.55	-35,818,195.77	-472,763,593.32
其中：1. 基金申购款	393,301,563.58	164,739,469.58	558,041,033.16
2. 基金赎回款	-830,246,961.13	-200,557,665.35	-1,030,804,626.48
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）	300,223,083.71	152,742,133.11	452,965,216.82

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 基金基本情况

南方策略优化混合型证券投资基金(原名为南方策略优化股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第9号《关于核准南方策略优化股票型证券投资基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方策略优化股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,172,744,590.51元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第073号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方策略优化股票型证券投资基金基金合同》于2010年3月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,173,254,149.88份基金份额,其中认购资金利息折合509,559.37份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,南方策略优化股票型证券投资基金于2015年8月7日公告后更名为南方策略优化混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方策略优化混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的各类股票、债券、短期金融工具、现金、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%,债券等固定收益类工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具的投资占基金资产的比例范围为5%-40%。固定收益类工具主要包括国债、金融债、公司债(企业债)、央行票据、短期融资券、可转换债券、回购、资产证券化产品、货币市场工具等,其中现金以及到期日在1年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数+20%×上证国债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于2017年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方策略优化混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现

部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关

于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	135,093,667.58	50,937,223.20
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	135,093,667.58	50,937,223.20

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,373,775,486.68	1,359,791,002.84	-13,984,483.84
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,373,775,486.68	1,359,791,002.84	-13,984,483.84
项目		上年度末		
		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		344,627,377.66	400,981,001.22	56,353,623.56
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		344,627,377.66	400,981,001.22	56,353,623.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	50,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	50,000,000.00	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	21,659.36	10,234.65
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,575.55	627.99
应收债券利息	-	-

应收买入返售证券利息	1,670.14	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	155.10	86.57
合计	27,060.15	10,949.21

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,726,995.07	3,458,858.14
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,726,995.07	3,458,858.14

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
应付赎回费	18,891.31	2,314.57
预提费用	355,000.00	355,000.00
合计	373,891.31	357,314.57

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	300,223,083.71	300,223,083.71
本期申购	924,317,325.34	924,317,325.34
本期赎回（以“-”号填列）	-283,999,399.59	-283,999,399.59
本期末	940,541,009.46	940,541,009.46

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	112,359,112.58	40,383,020.53	152,742,133.11
本期利润	96,124,290.63	-70,338,107.40	25,786,183.23
本期基金份额交易产生的变动数	341,249,470.59	35,311,956.30	376,561,426.89
其中：基金申购款	484,887,992.21	37,433,535.48	522,321,527.69
基金赎回款	-143,638,521.62	-2,121,579.18	-145,760,100.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	549,732,873.80	5,356,869.43	555,089,743.23

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	465,871.46	319,127.91
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	37,650.57	45,327.60
其他	14,320.50	6,541.48
合计	517,842.53	370,996.99

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	2,546,766,172.41	2,902,773,676.24
减：卖出股票成本总额	2,434,785,695.83	2,587,597,401.81
买卖股票差价收入	111,980,476.58	315,176,274.43

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	13,991.20	945,529.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,000.00	526,000.00
减：应收利息总额	0.88	1,442.35
买卖债券差价收入	1,990.32	418,087.15

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	3,477,037.53	2,923,718.85
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	3,477,037.53	2,923,718.85
----	--------------	--------------

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-70,338,107.40	-61,572,692.52
——股票投资	-70,338,107.40	-61,422,479.42
——债券投资	-	-150,213.10
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-70,338,107.40	-61,572,692.52

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	410,394.11	526,114.02
基金转换费收入	70,380.45	158,933.14
合计	480,774.56	685,047.16

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	8,599,273.06	8,268,082.73
银行间市场交易费用	-	-
合计	8,599,273.06	8,268,082.73

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	3,352.07	11,435.21
账户维护费	18,000.00	13,500.00
合计	376,352.07	379,935.21

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税

应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		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	
	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	3,289,857,584.02	54.79%	566,990,218.34	10.65%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	3,018,399.40	54.68%	2,601,110.22	95.38%
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	501,737.29	10.47%	1,272,500.16	36.79%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年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	9,848,289.21	7,450,007.97
其中：支付销售机构的客户维护费	2,289,248.82	2,110,799.23

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 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	1,641,381.44	1,241,668.09

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 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 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	135,093,667.58	465,871.46	50,937,223.20	319,127.91

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	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	2017 年	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-

		12月 27日	1月 5日							
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	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

		30 日	10 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002652	扬子新材	2016 年 12 月 12 日	重大资产重组	18.11	-	-	500,300	8,224,396.92	9,060,433.00	-
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	83,010	5,561,036.92	6,500,513.10	-
300213	佳讯飞鸿	2016 年 11 月 4 日	重大资产重组	28.00	2017 年 2 月 17 日	25.48	174,100	5,004,187.42	4,874,800.00	-
300150	世纪瑞尔	2016 年 11 月 8 日	重大资产重组	9.97	2017 年 3 月 21 日	10.97	471,200	4,882,588.83	4,697,864.00	-
002578	闽发铝业	2016 年 10 月	重大资产重组	11.89	-	-	388,000	3,622,003.80	4,613,320.00	-

		12 日									
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	152,700	3,950,781.03	3,961,038.00	-	
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	327,200	3,296,706.80	3,402,880.00	-	
600189	吉林森 工	2016 年 7 月 8 日	重大资 产重组	12.05	2017 年 1 月 4 日	13.26	275,900	2,954,014.96	3,324,595.00	-	
002132	恒星科 技	2016 年 12 月 20 日	重大事 项	6.58	-	-	350,300	2,335,694.68	2,304,974.00	-	
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	86,800	1,943,367.84	1,918,280.00	-	
600649	城投控 股	2016 年 12 月 6 日	重大资 产重组	20.34	-	-	61,000	1,144,125.00	1,240,740.00	-	
002400	省广股 份	2016 年 11 月 28 日	重大事 项	13.79	-	-	36,400	479,987.00	501,956.00	-	
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	41,900	464,857.00	476,403.00	-	
600485	信威集 团	2016 年 12 月 26 日	重大事 项未公 告	14.60	-	-	30,800	519,910.00	449,680.00	-	

002335	科华恒盛	2016年 12月 16日	重大资 产重组	42.90	2017年 3月 27日	43.10	10,400	460,139.57	446,160.00	-
002462	嘉事堂	2016年 9月 28日	重大资 产重组	42.53	2017年 1月 12日	38.98	7,800	295,820.05	331,734.00	-
002567	唐人神	2016年 12月 22日	重大事 项	12.64	2017年 1月3日	12.75	24,900	338,085.16	314,736.00	-
600239	云南城投	2016年 12月 30日	重大事 项未公 告	5.66	2017年 1月3日	5.70	52,100	253,063.29	294,886.00	-
300065	海兰信	2016年 12月 8日	重大资 产重组	38.52	-	-	7,300	273,296.00	281,196.00	-
300098	高新兴	2016年 11月 17日	重大资 产重组	15.84	2017年 1月 23日	14.26	17,500	260,671.00	277,200.00	-
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	12,000	226,194.97	236,400.00	-
300047	天源迪科	2016年 8月 15日	重大资 产重组	19.90	2017年 1月6日	19.00	10,500	213,073.00	208,950.00	-
002129	中环股 份	2016年 4月 25日	重大事 项	8.27	-	-	23,400	210,872.00	193,518.00	-
000711	京蓝科 技	2016年 10月	重大资 产重组	32.54	2017年 3月	29.29	5,200	138,779.09	169,208.00	-

		19 日			13 日					
000903	云内动力	2016 年 12 月 22 日	重大事 项	8.76	2017 年 3 月 23 日	9.64	19,200	170,952.00	168,192.00	-
300223	北京君正	2016 年 12 月 19 日	重大事 项	48.40	-	-	3,300	104,152.46	159,720.00	-
600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	重大资 产重组	20.32	-	-	7,300	135,104.69	148,336.00	-
600090	同济堂	2016 年 12 月 26 日	重大事 项未公 告	11.75	2017 年 1 月 10 日	12.93	11,000	132,542.00	129,250.00	-
600747	大连控股	2016 年 11 月 2 日	重大资 产重组	5.20	-	-	23,600	115,499.00	122,720.00	-
002745	木林森	2016 年 7 月 15 日	重大资 产重组	36.49	-	-	1,300	41,764.00	47,437.00	-

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	135,093,667.58	-	-	-	135,093,667.58
结算备付金	7,223,244.41	-	-	-	7,223,244.41
存出保证金	313,302.15	-	-	-	313,302.15
交易性金融资产	-	-	-	1,359,791,002.84	1,359,791,002.84
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	50,000,000.00
应收利息	-	-	-	27,060.15	27,060.15
应收申购款	334,590.78	-	-	2,864,448.91	3,199,039.69
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	192,964,804.92	-	-	1,362,682,511.90	1,555,647,316.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	50,000,000.00	50,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	4,720,940.07	4,720,940.07
应付管理人报酬	-	-	-	1,881,203.72	1,881,203.72
应付托管费	-	-	-	313,533.96	313,533.96
应付交易费用	-	-	-	2,726,995.07	2,726,995.07
其他负债	-	-	-	373,891.31	373,891.31
负债总计	-	-	-	60,016,564.13	60,016,564.13
利率敏感度缺口	192,964,804.92	-	-	1,302,665,947.77	1,495,630,752.69
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	50,937,223.20	-	-	-	50,937,223.20
结算备付金	1,268,641.46	-	-	-	1,268,641.46
存出保证金	174,806.74	-	-	-	174,806.74
交易性金融资产	-	-	-	400,981,001.22	400,981,001.22
应收证券清算款	-	-	-	1,656,947.62	1,656,947.62
应收利息	-	-	-	10,949.21	10,949.21
应收申购款	194,428.62	-	-	3,982,432.27	4,176,860.89
资产总计	52,575,100.02	-	-	406,631,330.32	459,206,430.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,798,295.30	1,798,295.30
应付管理人报酬	-	-	-	537,210.43	537,210.43
应付托管费	-	-	-	89,535.08	89,535.08
应付交易费用	-	-	-	3,458,858.14	3,458,858.14
其他负债	-	-	-	357,314.57	357,314.57
负债总计	-	-	-	6,241,213.52	6,241,213.52
利率敏感度缺口	52,575,100.02	-	-	400,390,116.80	452,965,216.82

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项

的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中，股票占基金资产的 60%-95%；债券等固定收益类工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5-40%；权证占基金资产的 0-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,359,791,002.84	90.92	400,981,001.22	88.52
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,359,791,002.84	90.92	400,981,001.22	88.52

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末(2016年 12月31日)	上年度末(2015年 12月31日)
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升5%	增加约6,614	增加约2,280
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降5%	减少约6,614	减少约2,280

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,308,464,489.41元,属于第二层次的余额为51,326,513.43元,无第三层次(2015年12月31日:第一层次360,014,076.76元,第二层次40,729,388.46元,第三层次237,536.00元)。

(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

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具(2015年12月31日：237,536.00元)。本基金本期净转出第三层次的金额为237,536.00元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为零元（2015年度：净转入第三层次237,536.00元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动-551,828.00元）。

	交易性金融资产		合计
	债券投资	权益工具投资	
2016年1月1日	-	237,536.00	237,536.00
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层级	-	-	-
转出第三层级	-	-237,536.00	-237,536.00
当期利得或损失总额	-	-	-
计入损益的利得或损失	-	-	-
2016年12月31日	-	-	-
2016年12月31日仍持有的资产计入2016年度损益的未实现利得或损失的变动			
——公允价值变动损益	-	-	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

	交易性金融资产		合计
	债券投资	权益工具投资	
2015年1月1日	-	-	-
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层级	-	237,536.00	237,536.00
转出第三层级	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
计入损益的利得或损失	-	-	-
2015年12月31日	-	237,536.00	237,536.00

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照市盈率定价模型确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,359,791,002.84	87.41
	其中：股票	1,359,791,002.84	87.41
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	50,000,000.00	3.21
	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	142,316,911.99	9.15
7	其他各项资产	3,539,401.99	0.23
8	合计	1,555,647,316.82	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	17,438,750.60	1.17
B	采矿业	20,417,502.00	1.37
C	制造业	669,525,629.58	44.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	81,320,314.48	5.44

E	建筑业	37,390,694.41	2.50
F	批发和零售业	88,438,307.62	5.91
G	交通运输、仓储和邮政业	49,180,363.10	3.29
H	住宿和餐饮业	9,248,991.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,640,576.93	4.12
J	金融业	162,681,005.97	10.88
K	房地产业	76,467,852.90	5.11
L	租赁和商务服务业	15,590,925.50	1.04
M	科学研究和技术服务业	14,755,177.00	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	26,308,604.49	1.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,164,580.00	0.14
Q	卫生和社会工作	541,190.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	11,477,543.26	0.77
S	综合	15,202,994.00	1.02
	合计	1,359,791,002.84	90.92

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	640,700	22,700,001.00	1.52
2	601328	交通银行	3,544,800	20,453,496.00	1.37
3	600000	浦发银行	975,700	15,816,097.00	1.06
4	600016	民生银行	1,727,600	15,686,608.00	1.05
5	000002	万科 A	525,100	10,790,805.00	0.72
6	601127	小康股份	393,700	10,527,538.00	0.70

7	600015	华夏银行	948,759	10,294,035.15	0.69
8	600900	长江电力	741,500	9,387,390.00	0.63
9	002652	扬子新材	500,300	9,060,433.00	0.61
10	002169	智光电气	363,800	8,294,640.00	0.55
11	600215	长春经开	671,300	8,283,842.00	0.55
12	000407	胜利股份	884,800	8,149,008.00	0.54
13	600980	北矿科技	326,600	8,034,360.00	0.54
14	002066	瑞泰科技	416,700	7,900,632.00	0.53
15	002110	三钢闽光	593,500	7,834,200.00	0.52
16	601818	光大银行	1,958,700	7,658,517.00	0.51
17	000056	皇庭国际	577,400	7,650,550.00	0.51
18	600493	凤竹纺织	451,651	7,623,868.88	0.51
19	600385	山东金泰	319,000	7,595,390.00	0.51
20	000698	沈阳化工	962,400	7,593,336.00	0.51
21	600082	海泰发展	1,018,100	7,564,483.00	0.51
22	002697	红旗连锁	929,500	7,510,360.00	0.50
23	300283	温州宏丰	764,100	7,503,462.00	0.50
24	000789	万年青	924,600	7,424,538.00	0.50
25	000985	大庆华科	240,652	7,388,016.40	0.49
26	601996	丰林集团	779,800	7,330,120.00	0.49
27	002188	巴士在线	249,370	7,319,009.50	0.49
28	000159	国际实业	859,200	7,303,200.00	0.49
29	300344	太空板业	457,798	7,297,300.12	0.49
30	600695	绿庭投资	756,700	7,264,320.00	0.49
31	000619	海螺型材	597,600	7,219,008.00	0.48
32	600615	丰华股份	341,200	7,178,848.00	0.48
33	601579	会稽山	501,879	7,166,832.12	0.48
34	600573	惠泉啤酒	460,500	7,160,775.00	0.48

35	601007	金陵饭店	506,900	7,142,221.00	0.48
36	601668	中国建筑	805,800	7,139,388.00	0.48
37	600853	龙建股份	1,025,600	7,107,408.00	0.48
38	600213	亚星客车	455,100	7,090,458.00	0.47
39	000530	大冷股份	652,402	7,085,085.72	0.47
40	002119	康强电子	342,100	7,081,470.00	0.47
41	002225	濮耐股份	1,053,100	7,076,832.00	0.47
42	600159	大龙地产	1,313,900	7,016,226.00	0.47
43	000521	美菱电器	1,012,200	7,004,424.00	0.47
44	002442	龙星化工	500,300	6,984,188.00	0.47
45	300041	回天新材	558,300	6,973,167.00	0.47
46	000010	美丽生态	906,700	6,972,523.00	0.47
47	600203	福日电子	593,826	6,971,517.24	0.47
48	600644	乐山电力	760,800	6,968,928.00	0.47
49	000551	创元科技	659,700	6,959,835.00	0.47
50	600117	西宁特钢	1,240,400	6,958,644.00	0.47
51	600706	曲江文旅	350,500	6,953,920.00	0.46
52	600356	恒丰纸业	567,692	6,931,519.32	0.46
53	600128	弘业股份	454,800	6,917,508.00	0.46
54	002398	建研集团	508,800	6,909,504.00	0.46
55	000430	张家界	565,400	6,903,534.00	0.46
56	000753	漳州发展	1,384,069	6,892,663.62	0.46
57	300239	东宝生物	848,600	6,856,688.00	0.46
58	600163	中闽能源	1,249,300	6,846,164.00	0.46
59	002666	德联集团	820,100	6,839,634.00	0.46
60	002469	三维工程	765,800	6,830,936.00	0.46
61	300248	新开普	239,200	6,819,592.00	0.46
62	002750	龙津药业	409,400	6,808,322.00	0.46

63	002507	涪陵榨菜	508,500	6,803,730.00	0.45
64	000548	湖南投资	840,800	6,802,072.00	0.45
65	600127	金健米业	1,022,500	6,799,625.00	0.45
66	300130	新国都	273,453	6,789,837.99	0.45
67	300084	海默科技	582,800	6,789,620.00	0.45
68	002593	日上集团	921,000	6,778,560.00	0.45
69	002327	富安娜	768,300	6,761,040.00	0.45
70	002452	长高集团	718,200	6,751,080.00	0.45
71	002361	神剑股份	962,400	6,736,800.00	0.45
72	600975	新五丰	772,500	6,728,475.00	0.45
73	000419	通程控股	849,960	6,706,184.40	0.45
74	600393	粤泰股份	427,123	6,705,831.10	0.45
75	000978	桂林旅游	589,577	6,703,490.49	0.45
76	002014	永新股份	418,400	6,694,400.00	0.45
77	002214	大立科技	605,800	6,694,090.00	0.45
78	600371	万向德农	409,220	6,682,562.60	0.45
79	600854	春兰股份	899,800	6,658,520.00	0.45
80	600714	金瑞矿业	432,000	6,657,120.00	0.45
81	600231	凌钢股份	2,446,300	6,629,473.00	0.44
82	002193	山东如意	293,900	6,598,055.00	0.44
83	601601	中国太保	237,300	6,589,821.00	0.44
84	002660	茂硕电源	433,000	6,581,600.00	0.44
85	600167	联美控股	395,500	6,573,210.00	0.44
86	300040	九洲电气	573,300	6,570,018.00	0.44
87	000632	三木集团	773,257	6,557,219.36	0.44
88	300250	初灵信息	204,383	6,550,475.15	0.44
89	000591	太阳能	481,300	6,526,428.00	0.44
90	600483	福能股份	587,600	6,504,732.00	0.43

91	600892	大晟文化	83,010	6,500,513.10	0.43
92	002164	宁波东力	581,800	6,498,706.00	0.43
93	603020	爱普股份	319,000	6,488,460.00	0.43
94	000421	南京公用	729,244	6,482,979.16	0.43
95	002553	南方轴承	526,300	6,473,490.00	0.43
96	600235	民丰特纸	609,400	6,465,734.00	0.43
97	000723	美锦能源	427,300	6,460,776.00	0.43
98	300249	依米康	469,400	6,374,452.00	0.43
99	002357	富临运业	418,531	6,370,041.82	0.43
100	002279	久其软件	371,200	6,366,080.00	0.43
101	002535	林州重机	977,200	6,361,572.00	0.43
102	300057	万顺股份	451,663	6,332,315.26	0.42
103	600891	秋林集团	678,800	6,326,416.00	0.42
104	000657	中钨高新	433,800	6,303,114.00	0.42
105	300272	开能环保	428,700	6,276,168.00	0.42
106	300335	迪森股份	359,901	6,269,475.42	0.42
107	000597	东北制药	623,410	6,234,100.00	0.42
108	000796	凯撒旅游	411,200	6,229,680.00	0.42
109	601008	连云港	1,136,120	6,225,937.60	0.42
110	300241	瑞丰光电	385,110	6,211,824.30	0.42
111	600984	建设机械	707,200	6,180,928.00	0.41
112	300074	华平股份	669,700	6,161,240.00	0.41
113	600681	百川能源	382,861	6,064,518.24	0.41
114	000429	粤高速 A	879,800	6,017,832.00	0.40
115	300013	新宁物流	463,000	5,986,590.00	0.40
116	002446	盛路通信	266,964	5,985,332.88	0.40
117	000498	山东路桥	751,600	5,960,188.00	0.40
118	601169	北京银行	581,420	5,674,659.20	0.38

119	600837	海通证券	359,800	5,666,850.00	0.38
120	002404	嘉欣丝绸	622,500	5,627,400.00	0.38
121	603003	龙宇燃油	279,200	5,623,088.00	0.38
122	601288	农业银行	1,805,900	5,598,290.00	0.37
123	601015	陕西黑猫	586,000	5,590,440.00	0.37
124	002661	克明面业	337,021	5,554,106.08	0.37
125	300211	亿通科技	439,300	5,447,320.00	0.36
126	601398	工商银行	1,213,300	5,350,653.00	0.36
127	601166	兴业银行	306,900	4,953,366.00	0.33
128	300051	三五互联	337,800	4,948,770.00	0.33
129	300213	佳讯飞鸿	174,100	4,874,800.00	0.33
130	600462	九有股份	560,600	4,860,402.00	0.32
131	002397	梦洁股份	587,900	4,761,990.00	0.32
132	002607	亚夏汽车	441,800	4,705,170.00	0.31
133	300150	世纪瑞尔	471,200	4,697,864.00	0.31
134	002304	洋河股份	66,200	4,673,720.00	0.31
135	002578	闽发铝业	388,000	4,613,320.00	0.31
136	000716	黑芝麻	546,900	4,408,014.00	0.29
137	601009	南京银行	375,113	4,066,224.92	0.27
138	600513	联环药业	230,650	4,027,149.00	0.27
139	000705	浙江震元	307,300	4,016,411.00	0.27
140	000887	中鼎股份	152,700	3,961,038.00	0.26
141	600048	保利地产	432,100	3,945,073.00	0.26
142	601988	中国银行	1,129,300	3,884,792.00	0.26
143	600028	中国石化	717,300	3,880,593.00	0.26
144	601939	建设银行	699,900	3,807,456.00	0.25
145	600309	万华化学	171,400	3,690,242.00	0.25
146	601633	长城汽车	333,100	3,684,086.00	0.25

147	600518	康美药业	197,500	3,525,375.00	0.24
148	002478	常宝股份	262,900	3,459,764.00	0.23
149	600340	华夏幸福	143,900	3,439,210.00	0.23
150	600009	上海机场	128,800	3,415,776.00	0.23
151	000560	昆百大A	327,200	3,402,880.00	0.23
152	300312	邦讯技术	236,000	3,367,720.00	0.23
153	600189	吉林森工	275,900	3,324,595.00	0.22
154	000001	平安银行	351,957	3,202,808.70	0.21
155	000858	五粮液	91,300	3,148,024.00	0.21
156	600585	海螺水泥	178,300	3,023,968.00	0.20
157	002081	金螳螂	306,542	3,001,046.18	0.20
158	002040	南京港	144,500	2,975,255.00	0.20
159	600115	东方航空	420,700	2,974,349.00	0.20
160	000993	闽东电力	205,800	2,924,418.00	0.20
161	002493	荣盛石化	185,600	2,861,952.00	0.19
162	600519	贵州茅台	8,300	2,773,445.00	0.19
163	600373	中文传媒	132,700	2,680,540.00	0.18
164	600196	复星医药	115,700	2,677,298.00	0.18
165	002182	云海金属	142,900	2,659,369.00	0.18
166	600383	金地集团	203,000	2,630,880.00	0.18
167	000557	西部创业	477,000	2,594,880.00	0.17
168	300080	易成新能	263,300	2,590,872.00	0.17
169	601336	新华保险	58,600	2,565,508.00	0.17
170	002026	山东威达	218,000	2,517,900.00	0.17
171	002321	华英农业	230,900	2,472,939.00	0.17
172	600337	美克家居	173,500	2,456,760.00	0.16
173	300311	任子行	144,100	2,402,147.00	0.16
174	600232	金鹰股份	186,500	2,376,010.00	0.16

175	002142	宁波银行	141,800	2,359,552.00	0.16
176	603288	海天味业	78,700	2,308,271.00	0.15
177	002132	恒星科技	350,300	2,304,974.00	0.15
178	300129	泰胜风能	260,000	2,275,000.00	0.15
179	601088	中国神华	140,400	2,271,672.00	0.15
180	600361	华联综超	319,900	2,264,892.00	0.15
181	002674	兴业科技	127,200	2,259,072.00	0.15
182	000610	西安旅游	151,200	2,251,368.00	0.15
183	300089	文化长城	122,100	2,247,861.00	0.15
184	002545	东方铁塔	199,000	2,216,860.00	0.15
185	601186	中国铁建	184,600	2,207,816.00	0.15
186	000637	茂化实华	285,600	2,207,688.00	0.15
187	000708	大冶特钢	173,100	2,205,294.00	0.15
188	600345	长江通信	96,800	2,199,296.00	0.15
189	601177	杭齿前进	200,900	2,127,531.00	0.14
190	000420	吉林化纤	542,100	2,114,190.00	0.14
191	601137	博威合金	161,600	2,112,112.00	0.14
192	300172	中电环保	212,400	2,107,008.00	0.14
193	000721	西安饮食	228,500	2,106,770.00	0.14
194	002561	徐家汇	109,500	2,105,685.00	0.14
195	002677	浙江美大	179,500	2,100,150.00	0.14
196	002516	旷达科技	318,100	2,086,736.00	0.14
197	300270	中威电子	136,600	2,074,954.00	0.14
198	002483	润邦股份	174,300	2,054,997.00	0.14
199	000628	高新发展	144,200	2,054,850.00	0.14
200	002388	新亚制程	192,800	2,045,608.00	0.14
201	000681	视觉中国	106,700	2,033,702.00	0.14
202	300163	先锋新材	196,000	2,028,600.00	0.14

203	601998	中信银行	316,100	2,026,201.00	0.14
204	600661	新南洋	71,200	2,024,216.00	0.14
205	300240	飞力达	182,000	2,012,920.00	0.13
206	600333	长春燃气	255,500	2,008,230.00	0.13
207	600746	江苏索普	159,900	2,006,745.00	0.13
208	300025	华星创业	180,900	1,989,900.00	0.13
209	600088	中视传媒	90,530	1,984,417.60	0.13
210	002146	荣盛发展	248,300	1,949,155.00	0.13
211	600637	东方明珠	82,900	1,931,570.00	0.13
212	002148	北纬通信	101,100	1,926,966.00	0.13
213	300247	乐金健康	235,500	1,926,390.00	0.13
214	000411	英特集团	86,800	1,918,280.00	0.13
215	600816	安信信托	79,700	1,882,514.00	0.13
216	002612	朗姿股份	103,600	1,877,232.00	0.13
217	600398	海澜之家	171,100	1,846,169.00	0.12
218	002594	比亚迪	37,100	1,843,128.00	0.12
219	300162	雷曼股份	127,400	1,821,820.00	0.12
220	000880	潍柴重机	129,400	1,812,894.00	0.12
221	600030	中信证券	112,300	1,803,538.00	0.12
222	600019	宝钢股份	283,700	1,801,495.00	0.12
223	600479	千金药业	109,900	1,733,123.00	0.12
224	601788	光大证券	107,800	1,723,722.00	0.12
225	601607	上海医药	85,000	1,662,600.00	0.11
226	002209	达意隆	65,000	1,507,350.00	0.10
227	002032	苏泊尔	42,000	1,466,640.00	0.10
228	600867	通化东宝	66,300	1,453,959.00	0.10
229	300112	万讯自控	100,900	1,441,861.00	0.10
230	000338	潍柴动力	141,200	1,406,352.00	0.09

231	600510	黑牡丹	161,200	1,391,156.00	0.09
232	000732	泰禾集团	77,000	1,362,130.00	0.09
233	600068	葛洲坝	146,400	1,345,416.00	0.09
234	600004	白云机场	94,100	1,325,869.00	0.09
235	600741	华域汽车	78,400	1,250,480.00	0.08
236	002417	三元达	76,900	1,249,625.00	0.08
237	601800	中国交建	81,700	1,241,023.00	0.08
238	600649	城投控股	61,000	1,240,740.00	0.08
239	000069	华侨城 A	175,100	1,216,945.00	0.08
240	002370	亚太药业	41,500	1,215,950.00	0.08
241	600276	恒瑞医药	26,500	1,205,750.00	0.08
242	600079	人福医药	60,300	1,202,985.00	0.08
243	000963	华东医药	16,400	1,181,948.00	0.08
244	600999	招商证券	71,200	1,162,696.00	0.08
245	000623	吉林敖东	37,100	1,149,729.00	0.08
246	600023	浙能电力	210,100	1,140,843.00	0.08
247	000568	泸州老窖	34,300	1,131,900.00	0.08
248	600718	东软集团	57,200	1,124,552.00	0.08
249	002475	立讯精密	53,400	1,108,050.00	0.07
250	601238	广汽集团	45,600	1,056,552.00	0.07
251	002198	嘉应制药	77,800	1,051,856.00	0.07
252	002595	豪迈科技	49,400	1,039,870.00	0.07
253	601139	深圳燃气	111,000	1,008,990.00	0.07
254	300003	乐普医疗	56,200	1,007,666.00	0.07
255	000665	湖北广电	69,900	998,172.00	0.07
256	002187	广百股份	68,700	970,044.00	0.06
257	000917	电广传媒	65,100	936,789.00	0.06
258	002219	恒康医疗	78,100	935,638.00	0.06

259	002693	双成药业	86,200	929,236.00	0.06
260	002422	科伦药业	55,760	898,851.20	0.06
261	002465	海格通信	76,400	890,060.00	0.06
262	600007	中国国贸	51,300	885,951.00	0.06
263	002359	齐星铁塔	30,700	877,099.00	0.06
264	002309	中利科技	61,600	875,336.00	0.06
265	600835	上海机电	44,500	868,640.00	0.06
266	600332	白云山	36,000	863,280.00	0.06
267	600236	桂冠电力	138,800	846,680.00	0.06
268	601333	广深铁路	166,600	844,662.00	0.06
269	002714	牧原股份	35,900	835,752.00	0.06
270	600241	时代万恒	53,800	831,748.00	0.06
271	300448	浩云科技	27,300	815,724.00	0.05
272	002385	大北农	114,500	812,950.00	0.05
273	000402	金融街	78,900	812,670.00	0.05
274	000046	泛海控股	87,400	811,946.00	0.05
275	601111	中国国航	110,700	797,040.00	0.05
276	002416	爱施德	53,900	793,947.00	0.05
277	300058	蓝色光标	77,100	784,107.00	0.05
278	002015	霞客环保	87,900	774,399.00	0.05
279	600894	广日股份	54,200	740,914.00	0.05
280	600882	广泽股份	68,100	731,394.00	0.05
281	600594	益佰制药	43,400	722,610.00	0.05
282	600266	北京城建	53,600	714,488.00	0.05
283	600663	陆家嘴	32,200	712,586.00	0.05
284	600056	中国医药	36,900	702,207.00	0.05
285	600208	新湖中宝	167,800	698,048.00	0.05
286	000546	金圆股份	60,200	681,464.00	0.05

287	600895	张江高科	38,300	678,676.00	0.05
288	601098	中南传媒	40,501	674,746.66	0.05
289	600704	物产中大	65,000	671,450.00	0.04
290	600568	中珠医疗	26,800	670,000.00	0.04
291	600376	首开股份	56,500	667,265.00	0.04
292	300203	聚光科技	21,800	665,990.00	0.04
293	002738	中矿资源	24,100	635,517.00	0.04
294	002275	桂林三金	34,400	631,928.00	0.04
295	002232	启明信息	47,400	630,894.00	0.04
296	000999	华润三九	25,400	628,142.00	0.04
297	300002	神州泰岳	67,600	624,624.00	0.04
298	002303	美盈森	60,700	623,996.00	0.04
299	603898	好莱客	19,000	615,030.00	0.04
300	002152	广电运通	46,300	614,864.00	0.04
301	601677	明泰铝业	41,000	606,800.00	0.04
302	601992	金隅股份	134,800	601,208.00	0.04
303	600037	歌华有线	39,100	599,012.00	0.04
304	600297	广汇汽车	69,500	594,920.00	0.04
305	002217	合力泰	32,900	588,910.00	0.04
306	600438	通威股份	90,500	576,485.00	0.04
307	000921	海信科龙	56,100	572,781.00	0.04
308	300265	通光线缆	38,800	572,300.00	0.04
309	600104	上汽集团	24,400	572,180.00	0.04
310	600511	国药股份	18,900	568,890.00	0.04
311	002540	亚太科技	72,400	568,340.00	0.04
312	600525	长园集团	40,400	563,580.00	0.04
313	300148	天舟文化	27,000	563,220.00	0.04
314	603969	银龙股份	40,400	563,176.00	0.04

315	000778	新兴铸管	107,600	556,292.00	0.04
316	002410	广联达	37,900	553,340.00	0.04
317	002294	信立泰	18,900	552,636.00	0.04
318	002511	中顺洁柔	27,700	551,230.00	0.04
319	600845	宝信软件	31,200	550,368.00	0.04
320	600638	新黄浦	31,000	548,390.00	0.04
321	002537	海立美达	16,900	547,222.00	0.04
322	002667	鞍重股份	19,400	546,304.00	0.04
323	600038	中直股份	11,200	542,304.00	0.04
324	300015	爱尔眼科	18,100	541,190.00	0.04
325	601588	北辰实业	129,100	538,347.00	0.04
326	300204	舒泰神	30,300	537,219.00	0.04
327	600062	华润双鹤	24,100	535,743.00	0.04
328	600507	方大特钢	79,100	535,507.00	0.04
329	300199	翰宇药业	29,700	534,006.00	0.04
330	002662	京威股份	32,300	531,335.00	0.04
331	000766	通化金马	30,100	528,556.00	0.04
332	002626	金达威	38,000	527,820.00	0.04
333	002001	新和成	26,700	523,320.00	0.03
334	000915	山大华特	12,400	522,412.00	0.03
335	600267	海正药业	39,400	518,110.00	0.03
336	000028	国药一致	7,600	508,440.00	0.03
337	002262	恩华药业	24,300	507,870.00	0.03
338	300267	尔康制药	38,700	505,035.00	0.03
339	002400	省广股份	36,400	501,956.00	0.03
340	000883	湖北能源	109,300	500,594.00	0.03
341	002415	海康威视	21,000	500,010.00	0.03
342	600094	大名城	55,400	493,060.00	0.03

343	002518	科士达	23,000	491,970.00	0.03
344	600557	康缘药业	28,900	489,277.00	0.03
345	600959	江苏有线	43,200	488,160.00	0.03
346	600641	万业企业	39,300	485,748.00	0.03
347	002519	银河电子	21,600	483,840.00	0.03
348	600814	杭州解百	41,900	476,403.00	0.03
349	002195	二三四五	42,000	475,440.00	0.03
350	600998	九州通	22,900	474,946.00	0.03
351	300134	大富科技	18,700	474,232.00	0.03
352	300251	光线传媒	48,500	473,360.00	0.03
353	002653	海思科	29,900	467,337.00	0.03
354	002433	太安堂	43,000	466,120.00	0.03
355	002150	通润装备	27,800	460,090.00	0.03
356	000979	中弘股份	173,300	457,512.00	0.03
357	603008	喜临门	25,000	457,500.00	0.03
358	600587	新华医疗	18,200	457,002.00	0.03
359	600185	格力地产	78,500	456,085.00	0.03
360	002484	江海股份	27,600	453,468.00	0.03
361	300133	华策影视	39,700	450,595.00	0.03
362	600429	三元股份	57,400	450,590.00	0.03
363	000938	紫光股份	7,836	449,708.04	0.03
364	600485	信威集团	30,800	449,680.00	0.03
365	002335	科华恒盛	10,400	446,160.00	0.03
366	300326	凯利泰	40,100	445,912.00	0.03
367	600098	广州发展	39,700	445,434.00	0.03
368	002589	瑞康医药	13,700	444,565.00	0.03
369	600064	南京高科	26,500	443,875.00	0.03
370	600572	康恩贝	60,600	442,986.00	0.03

371	600325	华发股份	34,600	442,880.00	0.03
372	002399	海普瑞	24,300	442,746.00	0.03
373	600285	羚锐制药	34,600	441,496.00	0.03
374	600210	紫江企业	81,000	438,210.00	0.03
375	603369	今世缘	33,400	438,208.00	0.03
376	600323	瀚蓝环境	30,500	437,980.00	0.03
377	002296	辉煌科技	27,700	437,383.00	0.03
378	000156	华数传媒	24,400	437,004.00	0.03
379	002153	石基信息	17,900	436,223.00	0.03
380	603885	吉祥航空	18,500	431,050.00	0.03
381	002065	东华软件	18,200	424,060.00	0.03
382	600724	宁波富达	70,200	417,690.00	0.03
383	600055	万东医疗	22,900	414,948.00	0.03
384	600316	洪都航空	21,100	414,826.00	0.03
385	300291	华录百纳	18,500	412,180.00	0.03
386	000513	丽珠集团	6,815	405,492.50	0.03
387	300010	立思辰	24,200	402,204.00	0.03
388	000926	福星股份	31,500	401,310.00	0.03
389	000860	顺鑫农业	18,100	398,200.00	0.03
390	000043	中航地产	32,400	397,224.00	0.03
391	002557	洽洽食品	24,700	396,682.00	0.03
392	600029	南方航空	56,500	396,630.00	0.03
393	600482	中国动力	12,900	393,966.00	0.03
394	300315	掌趣科技	42,300	390,852.00	0.03
395	000034	神州数码	17,500	390,600.00	0.03
396	300147	香雪制药	30,200	389,580.00	0.03
397	000965	天保基建	58,100	387,527.00	0.03
398	002048	宁波华翔	17,400	385,236.00	0.03

399	600604	市北高新	18,600	384,462.00	0.03
400	600884	杉杉股份	27,300	384,384.00	0.03
401	300252	金信诺	12,900	383,259.00	0.03
402	300294	博雅生物	6,800	383,180.00	0.03
403	600705	中航资本	62,500	382,500.00	0.03
404	300166	东方国信	18,300	380,457.00	0.03
405	002116	中国海诚	28,300	379,220.00	0.03
406	600848	上海临港	19,500	377,325.00	0.03
407	002675	东诚药业	26,200	374,660.00	0.03
408	000967	盈峰环境	26,500	370,470.00	0.02
409	000667	美好置业	100,200	369,738.00	0.02
410	600067	冠城大通	51,100	365,876.00	0.02
411	002006	精功科技	32,500	364,000.00	0.02
412	600713	南京医药	45,600	362,520.00	0.02
413	002603	以岭药业	20,900	360,316.00	0.02
414	600077	宋都股份	65,100	355,446.00	0.02
415	300354	东华测试	14,500	353,800.00	0.02
416	000636	风华高科	36,000	351,360.00	0.02
417	002244	滨江集团	49,900	348,302.00	0.02
418	000572	海马汽车	64,400	345,184.00	0.02
419	600246	万通地产	59,200	342,176.00	0.02
420	002583	海能达	25,900	342,139.00	0.02
421	603011	合锻智能	29,600	341,584.00	0.02
422	600322	天房发展	53,700	339,921.00	0.02
423	300269	联建光电	14,700	339,864.00	0.02
424	300114	中航电测	14,800	337,144.00	0.02
425	300205	天喻信息	23,200	332,688.00	0.02
426	002441	众业达	24,800	331,824.00	0.02

427	002462	嘉事堂	7,800	331,734.00	0.02
428	600677	航天通信	19,300	331,574.00	0.02
429	000040	东旭蓝天	26,800	329,372.00	0.02
430	600452	涪陵电力	7,900	329,272.00	0.02
431	000673	当代东方	23,600	327,096.00	0.02
432	002505	大康农业	92,200	326,388.00	0.02
433	002394	联发股份	18,300	323,544.00	0.02
434	000722	湖南发展	22,700	322,567.00	0.02
435	001896	豫能控股	32,200	322,322.00	0.02
436	603609	禾丰牧业	24,800	320,664.00	0.02
437	600736	苏州高新	34,900	315,147.00	0.02
438	300342	天银机电	13,700	315,100.00	0.02
439	002567	唐人神	24,900	314,736.00	0.02
440	300049	福瑞股份	15,000	314,250.00	0.02
441	002218	拓日新能	34,800	312,852.00	0.02
442	002383	合众思壮	6,300	311,850.00	0.02
443	300158	振东制药	15,900	311,322.00	0.02
444	600529	山东药玻	14,527	308,844.02	0.02
445	300036	超图软件	17,700	307,980.00	0.02
446	300310	宜通世纪	12,600	306,684.00	0.02
447	300397	天和防务	11,800	304,204.00	0.02
448	002285	世联行	40,000	304,000.00	0.02
449	600053	九鼎投资	6,600	303,996.00	0.02
450	601258	庞大集团	109,500	303,315.00	0.02
451	600178	东安动力	27,400	302,496.00	0.02
452	002305	南国置业	58,000	301,020.00	0.02
453	002016	世荣兆业	31,400	300,498.00	0.02
454	300157	恒泰艾普	32,600	299,594.00	0.02

455	300038	梅泰诺	6,800	297,432.00	0.02
456	603939	益丰药房	10,000	296,400.00	0.02
457	300182	捷成股份	28,693	295,824.83	0.02
458	600239	云南城投	52,100	294,886.00	0.02
459	600757	长江传媒	35,400	294,174.00	0.02
460	002373	千方科技	21,300	293,940.00	0.02
461	300048	合康新能	35,700	293,454.00	0.02
462	002354	天神娱乐	4,200	290,472.00	0.02
463	600051	宁波联合	22,200	290,154.00	0.02
464	002376	新北洋	23,300	288,920.00	0.02
465	000736	中房地产	14,600	283,970.00	0.02
466	000581	威孚高科	12,600	282,744.00	0.02
467	000971	高升控股	11,900	281,435.00	0.02
468	300065	海兰信	7,300	281,196.00	0.02
469	002317	众生药业	22,600	279,110.00	0.02
470	300395	菲利华	12,000	278,040.00	0.02
471	300098	高新兴	17,500	277,200.00	0.02
472	300006	莱美药业	32,700	276,315.00	0.02
473	600716	凤凰股份	36,000	276,120.00	0.02
474	002349	精华制药	13,700	276,055.00	0.02
475	600327	大东方	29,500	274,350.00	0.02
476	600684	珠江实业	34,600	271,956.00	0.02
477	600461	洪城水业	35,500	270,155.00	0.02
478	002520	日发精机	22,700	268,995.00	0.02
479	002414	高德红外	11,800	268,804.00	0.02
480	600831	广电网络	20,500	267,730.00	0.02
481	600223	鲁商置业	48,700	264,928.00	0.02
482	002430	杭氧股份	30,500	263,825.00	0.02

483	600362	江西铜业	15,700	262,661.00	0.02
484	600841	上柴股份	16,600	262,114.00	0.02
485	600790	轻纺城	35,900	258,480.00	0.02
486	002174	游族网络	9,764	258,257.80	0.02
487	300209	天泽信息	10,300	256,264.00	0.02
488	601233	桐昆股份	17,800	255,608.00	0.02
489	002220	天宝股份	18,900	254,961.00	0.02
490	600748	上实发展	31,020	254,053.80	0.02
491	002548	金新农	17,600	253,968.00	0.02
492	002208	合肥城建	15,600	251,004.00	0.02
493	000488	晨鸣纸业	24,200	250,712.00	0.02
494	002077	大港股份	13,900	248,532.00	0.02
495	600616	金枫酒业	20,200	248,460.00	0.02
496	300086	康芝药业	17,800	247,776.00	0.02
497	600674	川投能源	28,300	246,210.00	0.02
498	600969	郴电国际	12,900	245,874.00	0.02
499	002295	精艺股份	13,630	245,748.90	0.02
500	600850	华东电脑	10,100	244,218.00	0.02
501	002243	通产丽星	17,900	244,156.00	0.02
502	000030	富奥股份	28,700	243,950.00	0.02
503	002155	湖南黄金	21,300	243,885.00	0.02
504	000989	九芝堂	10,900	236,639.00	0.02
505	002396	星网锐捷	12,000	236,400.00	0.02
506	600976	健民集团	7,400	236,282.00	0.02
507	603168	莎普爱思	5,600	235,928.00	0.02
508	000620	新华联	27,700	234,896.00	0.02
509	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.02
510	000919	金陵药业	17,300	234,069.00	0.02

511	600509	天富能源	31,100	232,317.00	0.02
512	002253	川大智胜	9,200	229,448.00	0.02
513	300334	津膜科技	12,600	229,068.00	0.02
514	000544	中原环保	13,100	227,678.00	0.02
515	600059	古越龙山	22,200	227,328.00	0.02
516	300177	中海达	15,300	227,205.00	0.02
517	601799	星宇股份	5,900	227,150.00	0.02
518	000537	广宇发展	24,900	226,092.00	0.02
519	002521	齐峰新材	20,900	224,675.00	0.02
520	600657	信达地产	36,800	224,480.00	0.02
521	600665	天地源	42,100	223,551.00	0.01
522	002365	永安药业	8,900	222,945.00	0.01
523	002259	升达林业	22,200	222,444.00	0.01
524	600162	香江控股	56,000	222,320.00	0.01
525	601058	赛轮金宇	54,600	222,222.00	0.01
526	300379	东方通	3,200	222,048.00	0.01
527	002103	广博股份	12,800	221,824.00	0.01
528	002536	西泵股份	15,600	220,272.00	0.01
529	000869	张裕 A	6,100	219,600.00	0.01
530	300264	佳创视讯	20,600	218,360.00	0.01
531	600066	宇通客车	10,900	213,531.00	0.01
532	002412	汉森制药	11,700	212,706.00	0.01
533	300255	常山药业	26,700	210,930.00	0.01
534	300079	数码视讯	29,400	210,504.00	0.01
535	300476	胜宏科技	9,200	210,220.00	0.01
536	300047	天源迪科	10,500	208,950.00	0.01
537	300319	麦捷科技	5,300	208,237.00	0.01
538	000863	三湘印象	24,500	208,005.00	0.01

539	300194	福安药业	7,900	207,770.00	0.01
540	300119	瑞普生物	12,000	206,280.00	0.01
541	600466	蓝光发展	21,200	205,004.00	0.01
542	300356	光一科技	5,900	203,845.00	0.01
543	600743	华远地产	45,800	203,810.00	0.01
544	002129	中环股份	23,400	193,518.00	0.01
545	002701	奥瑞金	22,300	192,672.00	0.01
546	002247	帝龙文化	10,500	189,945.00	0.01
547	002624	完美世界	6,300	187,677.00	0.01
548	600818	中路股份	5,600	186,928.00	0.01
549	002087	新野纺织	26,226	183,582.00	0.01
550	600191	华资实业	13,100	182,352.00	0.01
551	000587	金洲慈航	12,200	181,536.00	0.01
552	300303	聚飞光电	20,200	178,164.00	0.01
553	300170	汉得信息	15,000	177,150.00	0.01
554	000631	顺发恒业	36,000	176,400.00	0.01
555	600308	华泰股份	32,400	176,256.00	0.01
556	300365	恒华科技	4,200	174,300.00	0.01
557	300229	拓尔思	10,500	173,355.00	0.01
558	000401	冀东水泥	14,500	172,550.00	0.01
559	000713	丰乐种业	14,600	170,090.00	0.01
560	300318	博晖创新	18,700	169,422.00	0.01
561	000711	京蓝科技	5,200	169,208.00	0.01
562	300378	鼎捷软件	7,100	168,270.00	0.01
563	000903	云内动力	19,200	168,192.00	0.01
564	300042	朗科科技	5,300	167,215.00	0.01
565	600668	尖峰集团	9,700	162,378.00	0.01
566	601101	昊华能源	24,100	160,988.00	0.01

567	300223	北京君正	3,300	159,720.00	0.01
568	002684	猛狮科技	4,900	159,642.00	0.01
569	002541	鸿路钢构	8,000	158,400.00	0.01
570	002143	印纪传媒	4,900	157,829.00	0.01
571	000517	荣安地产	29,900	157,274.00	0.01
572	002572	索菲亚	2,900	157,064.00	0.01
573	300468	四方精创	2,800	155,596.00	0.01
574	600606	绿地控股	17,800	155,038.00	0.01
575	300339	润和软件	4,900	149,940.00	0.01
576	300219	鸿利智汇	13,800	149,730.00	0.01
577	300138	晨光生物	8,198	149,449.54	0.01
578	000550	江铃汽车	5,500	148,500.00	0.01
579	600551	时代出版	7,300	148,336.00	0.01
580	002380	科远股份	5,100	146,727.00	0.01
581	002046	轴研科技	12,400	145,700.00	0.01
582	300258	精锻科技	9,800	143,668.00	0.01
583	300422	博世科	3,500	142,555.00	0.01
584	000526	紫光学大	3,600	140,364.00	0.01
585	600382	广东明珠	7,700	140,140.00	0.01
586	002770	科迪乳业	12,200	139,568.00	0.01
587	600819	耀皮玻璃	17,100	138,339.00	0.01
588	600386	北巴传媒	10,100	134,835.00	0.01
589	002615	哈尔斯	7,600	133,380.00	0.01
590	600820	隧道股份	12,000	132,120.00	0.01
591	600139	西部资源	11,800	131,924.00	0.01
592	600090	同济堂	11,000	129,250.00	0.01
593	300304	云意电气	2,800	128,520.00	0.01
594	002775	文科园林	5,600	126,224.00	0.01

595	600833	第一医药	6,000	123,300.00	0.01
596	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
597	603456	九洲药业	5,700	122,949.00	0.01
598	600747	大连控股	23,600	122,720.00	0.01
599	300373	扬杰科技	6,200	122,016.00	0.01
600	002200	云投生态	5,200	121,784.00	0.01
601	002461	珠江啤酒	10,000	120,500.00	0.01
602	000599	青岛双星	15,000	119,100.00	0.01
603	300358	楚天科技	6,800	117,232.00	0.01
604	000153	丰原药业	9,000	116,010.00	0.01
605	600188	兖州煤业	10,500	114,030.00	0.01
606	002705	新宝股份	6,600	111,606.00	0.01
607	002338	奥普光电	2,300	111,320.00	0.01
608	002649	博彦科技	2,800	108,920.00	0.01
609	300290	荣科科技	7,800	108,732.00	0.01
610	000701	厦门信达	7,000	107,590.00	0.01
611	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
612	300314	戴维医疗	5,000	106,300.00	0.01
613	002372	伟星新材	6,600	101,838.00	0.01
614	002149	西部材料	3,600	100,980.00	0.01
615	002696	百洋股份	4,400	100,760.00	0.01
616	002646	青青稞酒	5,000	96,250.00	0.01
617	300375	鹏翎股份	3,900	93,522.00	0.01
618	300419	浩丰科技	3,200	91,072.00	0.01
619	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
620	002062	宏润建设	13,000	87,100.00	0.01
621	002680	长生生物	4,900	84,770.00	0.01
622	300464	星徽精密	4,500	81,585.00	0.01

623	300301	长方集团	9,400	81,028.00	0.01
624	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.01
625	002582	好想你	2,000	70,420.00	0.00
626	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
627	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
628	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
629	300396	迪瑞医疗	1,800	68,094.00	0.00
630	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
631	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
632	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
633	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
634	002745	木林森	1,300	47,437.00	0.00
635	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
636	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
637	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
638	600960	渤海活塞	4,000	35,440.00	0.00
639	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
640	300412	迦南科技	1,000	35,100.00	0.00
641	300070	碧水源	1,700	29,784.00	0.00
642	603239	N 仙通	924	29,059.80	0.00
643	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
644	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
645	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
646	600262	北方股份	700	21,119.00	0.00
647	000910	大亚圣象	900	17,190.00	0.00
648	002599	盛通股份	400	15,796.00	0.00
649	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.00
650	300045	华力创通	1,000	13,270.00	0.00

651	002761	多喜爱	300	12,258.00	0.00
652	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
653	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
654	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
655	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
656	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
657	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
658	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
659	300072	三聚环保	46	2,129.34	0.00
660	601877	正泰电器	70	1,400.00	0.00
661	002049	紫光国芯	42	1,383.48	0.00
662	600498	烽火通信	53	1,336.13	0.00
663	002085	万丰奥威	66	1,304.16	0.00
664	601155	新城控股	72	846.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	35,858,170.61	7.92
2	600016	民生银行	29,032,830.73	6.41
3	600000	浦发银行	25,577,887.72	5.65
4	601328	交通银行	24,449,371.16	5.40
5	000002	万科 A	19,558,450.04	4.32
6	600015	华夏银行	15,140,644.44	3.34
7	600231	凌钢股份	14,718,556.04	3.25
8	300272	开能环保	14,289,566.08	3.15

9	600297	广汇汽车	13,391,752.75	2.96
10	002714	牧原股份	13,354,897.42	2.95
11	600698	湖南天雁	12,754,473.10	2.82
12	000938	紫光股份	12,619,760.58	2.79
13	002398	建研集团	12,605,821.42	2.78
14	002174	游族网络	12,559,715.82	2.77
15	002131	利欧股份	12,505,231.54	2.76
16	600482	中国动力	12,502,664.30	2.76
17	000627	天茂集团	12,437,457.89	2.75
18	601166	兴业银行	12,434,596.21	2.75
19	000671	阳光城	12,385,040.90	2.73
20	000591	太阳能	12,366,108.58	2.73
21	601155	新城控股	12,365,298.52	2.73
22	300182	捷成股份	12,333,274.46	2.72
23	600498	烽火通信	12,258,182.21	2.71
24	600754	锦江股份	12,231,856.44	2.70
25	000619	海螺型材	12,229,084.19	2.70
26	000718	苏宁环球	12,205,860.43	2.69
27	000008	神州高铁	12,158,865.07	2.68
28	600159	大龙地产	12,155,203.62	2.68
29	600900	长江电力	12,150,914.00	2.68
30	600082	海泰发展	12,029,801.37	2.66
31	601611	中国核建	12,025,628.92	2.65
32	300033	同花顺	11,977,468.40	2.64
33	600644	乐山电力	11,966,853.53	2.64
34	002466	天齐锂业	11,945,978.70	2.64
35	000521	美菱电器	11,941,288.35	2.64
36	300072	三聚环保	11,896,944.50	2.63

37	601127	小康股份	11,895,032.94	2.63
38	002797	第一创业	11,882,869.80	2.62
39	002049	紫光国芯	11,881,929.31	2.62
40	002310	东方园林	11,869,836.76	2.62
41	002426	胜利精密	11,862,572.90	2.62
42	000056	皇庭国际	11,832,341.79	2.61
43	000555	神州信息	11,798,509.00	2.60
44	601877	正泰电器	11,791,890.66	2.60
45	002299	圣农发展	11,731,244.81	2.59
46	002085	万丰奥威	11,715,908.21	2.59
47	600654	中安消	11,690,833.43	2.58
48	600371	万向德农	11,669,010.83	2.58
49	600706	曲江文旅	11,524,036.96	2.54
50	002074	国轩高科	11,503,837.38	2.54
51	002397	梦洁股份	11,493,694.43	2.54
52	600891	秋林集团	11,489,883.35	2.54
53	000597	东北制药	11,469,630.10	2.53
54	000985	大庆华科	11,429,747.20	2.52
55	600213	亚星客车	11,399,836.43	2.52
56	000993	闽东电力	11,133,421.42	2.46
57	000551	创元科技	11,108,370.48	2.45
58	002652	扬子新材	11,036,844.92	2.44
59	601398	工商银行	11,035,869.51	2.44
60	000419	通程控股	10,991,042.05	2.43
61	600167	联美控股	10,934,245.57	2.41
62	600235	民丰特纸	10,854,786.33	2.40
63	002507	涪陵榨菜	10,827,965.35	2.39
64	002304	洋河股份	10,812,672.30	2.39

65	600483	福能股份	10,789,098.37	2.38
66	002392	北京利尔	10,750,724.00	2.37
67	600203	福日电子	10,684,456.33	2.36
68	300283	温州宏丰	10,681,161.11	2.36
69	000430	张家界	10,650,676.46	2.35
70	002327	富安娜	10,632,900.58	2.35
71	601996	丰林集团	10,427,169.54	2.30
72	600128	弘业股份	10,045,258.56	2.22
73	600163	中闽能源	10,006,463.30	2.21
74	002014	永新股份	9,957,508.20	2.20
75	600361	华联综超	9,956,198.31	2.20
76	000789	万年青	9,938,191.35	2.19
77	601169	北京银行	9,889,501.15	2.18
78	000546	金圆股份	9,734,148.20	2.15
79	000716	黑芝麻	9,696,132.90	2.14
80	000530	大冷股份	9,636,380.34	2.13
81	601288	农业银行	9,624,138.00	2.12
82	601601	中国太保	9,616,448.00	2.12
83	600714	金瑞矿业	9,608,512.16	2.12
84	000782	美达股份	9,379,605.19	2.07
85	002110	三钢闽光	9,282,887.02	2.05
86	600889	南京化纤	9,175,191.59	2.03
87	601668	中国建筑	9,140,294.00	2.02
88	002124	天邦股份	9,093,587.48	2.01

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	600698	湖南天雁	13,295,966.11	2.94
2	601318	中国平安	13,234,741.00	2.92
3	601611	中国核建	12,995,352.22	2.87
4	300033	同花顺	12,767,684.20	2.82
5	601155	新城控股	12,766,097.97	2.82
6	600297	广汇汽车	12,763,109.05	2.82
7	600016	民生银行	12,614,858.56	2.78
8	600482	中国动力	12,606,846.62	2.78
9	002714	牧原股份	12,480,586.72	2.76
10	300182	捷成股份	12,443,740.50	2.75
11	601877	正泰电器	12,207,065.15	2.69
12	000627	天茂集团	12,198,975.12	2.69
13	000718	苏宁环球	12,133,991.70	2.68
14	002466	天齐锂业	12,067,963.50	2.66
15	002174	游族网络	12,036,134.89	2.66
16	600754	锦江股份	12,031,323.89	2.66
17	000671	阳光城	12,019,423.00	2.65
18	002131	利欧股份	12,014,977.26	2.65
19	000008	神州高铁	11,928,830.34	2.63
20	000938	紫光股份	11,917,631.00	2.63
21	600498	烽火通信	11,829,701.51	2.61
22	002426	胜利精密	11,665,421.50	2.58
23	300072	三聚环保	11,649,929.28	2.57
24	002310	东方园林	11,518,593.09	2.54
25	002085	万丰奥威	11,428,947.44	2.52
26	600654	中安消	11,398,668.93	2.52

27	002049	紫光国芯	11,258,812.70	2.49
28	002074	国轩高科	11,124,943.26	2.46
29	002523	天桥起重	11,050,441.28	2.44
30	600889	南京化纤	11,030,856.55	2.44
31	000555	神州信息	10,925,361.00	2.41
32	002299	圣农发展	10,884,445.43	2.40
33	002392	北京利尔	10,850,461.17	2.40
34	002797	第一创业	10,836,492.50	2.39
35	600791	京能置业	10,682,043.94	2.36
36	002295	精艺股份	10,625,701.20	2.35
37	300301	长方集团	10,591,825.33	2.34
38	600828	茂业商业	10,422,933.57	2.30
39	300138	晨光生物	10,284,880.87	2.27
40	000906	物产中拓	9,935,402.45	2.19
41	600000	浦发银行	9,772,392.88	2.16
42	601166	兴业银行	9,769,305.50	2.16
43	000782	美达股份	9,620,945.82	2.12
44	000002	万科 A	9,597,675.39	2.12
45	000993	闽东电力	9,589,364.00	2.12
46	000546	金圆股份	9,429,177.15	2.08
47	002087	新野纺织	9,132,725.48	2.02

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	3,463,933,804.85
卖出股票收入（成交）总额	2,546,766,172.41

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

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	313,302.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,060.15
5	应收申购款	3,199,039.69

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,539,401.99

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002652	扬子新材	9,060,433.00	0.61	重大事项未公告

§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
142,540	6,598.44	276,227,026.13	29.37%	664,313,983.33	70.63%

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	235,534.77	0.0250%

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	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年3月30日）基金份额总额	2,173,254,149.88
本报告期期初基金份额总额	300,223,083.71
本报告期基金总申购份额	924,317,325.34
减:本报告期基金总赎回份额	283,999,399.59
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	940,541,009.46

§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)有限公司审计费用 55,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 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	23	23,289,857,584.02	54.79%	3,018,399.40	54.68%	-
广发证券	11	1,334,274,832.31	22.22%	1,215,932.10	22.03%	-
银河证券	1	691,973,251.45	11.52%	644,435.84	11.67%	-
中投证券	1	590,471,988.25	9.83%	549,904.36	9.96%	-
国信证券	1	97,881,624.34	1.63%	91,157.63	1.65%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、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专用交易单元的选择标准和程序。

A：选择标准

- (a) 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- (b) 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；
- (c) 公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- (d) 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：

- (a) 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；

(b) 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；

(c) 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	-	-	-505,000,000.00	72.14%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-195,000,000.00	27.86%	-	-
中投证券	13,991.20	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月4日
2	南方基金管理有限公司关于在2016年1月4日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月4日
3	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月5日

	场内基金开放时间的公告		
4	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 5 日
5	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 7 日
6	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 8 日
7	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
8	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
9	南方基金关于旗下部分基金增加昆仑银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 26 日
10	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 26 日
11	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 27 日
12	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 28 日
13	南方基金关于旗下部分基金增加陆金所资管、唐鼎耀华为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 1 日
14	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 日

15	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年2月18日
16	关于南方策略优化混合型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月5日
17	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月9日
18	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月31日
19	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月12日
20	南方基金关于旗下部分基金增加德州银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月15日
21	南方基金关于旗下部分基金增加潍坊银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月26日
22	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年5月10日
23	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年5月13日
24	南方基金关于旗下部分基金增加泰隆银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月3日
25	南方基金关于旗下部分基金增加余杭农村商业银行作为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月23日

26	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月30日
27	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月30日
28	南方基金关于旗下部分基金增加苏宁基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年7月6日
29	南方基金关于旗下部分基金增加大智慧财富为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年7月26日
30	南方基金关于旗下部分基金增加广源达信为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年7月28日
31	南方基金关于旗下部分基金增加万得投顾为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年7月29日
32	南方基金关于旗下部分基金增加蛋卷基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年8月19日
33	南方基金关于旗下部分基金增加云湾投资为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年8月29日
34	南方基金关于旗下部分基金增加中正达广为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年9月6日
35	南方基金关于旗下部分基金增加永安期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年9月20日
36	南方基金关于旗下部分基金参加	中国证券报、上海	2016年9月20日

	交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
37	南方基金关于旗下部分基金增加途牛金服为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年9月28日
38	南方基金关于旗下部分基金增加东海期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年10月11日
39	南方基金关于旗下部分基金增加盛京银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年10月28日
40	南方基金关于旗下部分基金增加首创证券为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年11月9日
41	南方基金关于旗下部分基金增加弘业期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年11月16日
42	南方基金关于旗下部分基金增加富阳农商银行作为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年11月22日
43	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年11月29日
44	南方基金关于旗下部分基金增加长春农商银行作为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年11月29日
45	南方基金关于旗下部分基金增加	中国证券报、上海	2016年12月16日

	基煜基金为代销机构及开通相关业务公告	证券报、证券时报	
46	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 22 日
47	南方基金关于旗下部分基金增加齐商银行为代销机构及开通相关业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 23 日
48	南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 30 日
49	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 30 日
50	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行开放式公募基金交易优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 30 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方策略优化混合型证券投资基金的文件。
- 2、《南方策略优化混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《南方策略优化混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>