

南方优选价值混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017-06-30

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：2017-08-28

§ 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。本半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 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方优选价值混合	
基金主代码	202011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 6 月 18 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	879,999,180.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方优选价值混合 A	南方优选价值混合 H
下属分级基金的交易代码	202011	960020
下属分级基金的前端交易代码	202011	960020
下属分级基金的后端交易代码	202012	
报告期末下属分级基金的份额总额	879,956,584.46 份	42,595.68 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“南方价值”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，采用自下而上优选的模式，投资于资产价值有保障、并且具备价值释放条件（盈利能力持续稳定或处于经营反转）的上市公司，实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	采用“自下而上”的策略，比较上市公司的现有账面资产价值与股票投资价值，优选未来价值能够释放（盈利能力持续稳定或处于经营反转，未来两年盈利增长高于 GDP 增长）的上市公司作为主要投资对象。同时结合“自上而下”的行业分析，根据对宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以发现能够改变个股未来价值释放能力的系统性条件，从而以最低的组合风险优选并确定最优质的股票组合。
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	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日
	南方优选价值混合 A	南方优选价值混合 H
本期已实现收益	88,725,931.16	4,127.05
本期利润	136,763,698.06	5,691.03
加权平均基金份额本期利润	0.1636	0.1478
本期基金份额净值增长率	13.89%	13.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	0.3393	0.3386
期末基金资产净值	1,180,424,867.01	57,155.99
期末基金份额净值	1.341	1.342

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

南方优选价值混合 A

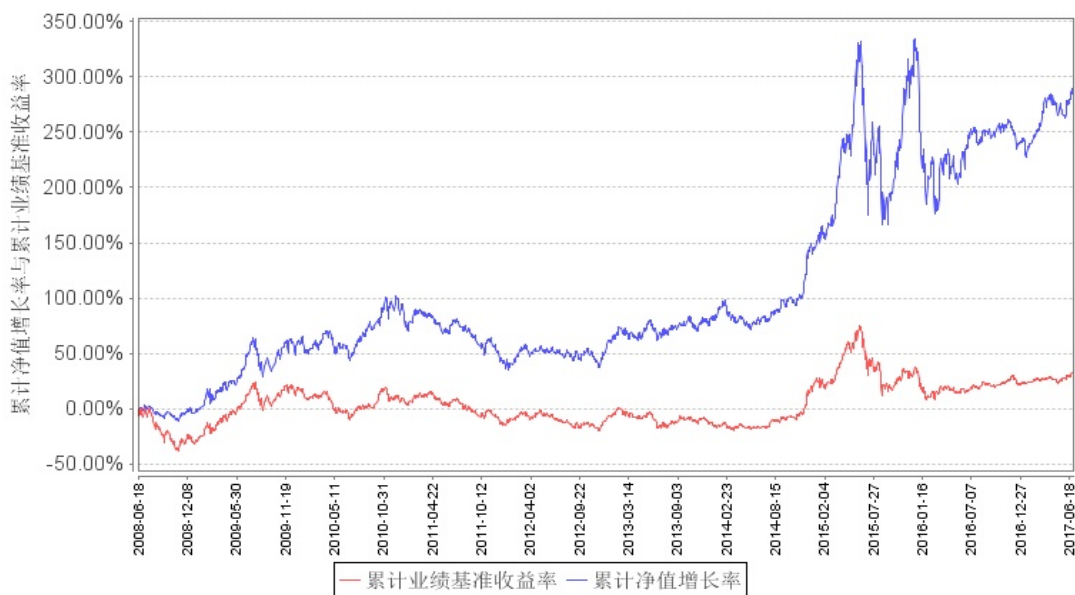
阶段	净值增长率 ① (%)	净值增长率 标准差 ② (%)	业绩比较基 准收益率 ③ (%)	业绩比较基 准收益率标 准差 ④ (%)	①— ③ (%)	②— ④ (%)
过去一个月	6.34	0.76	4.01	0.54	2.33	0.22
过去三个月	3.23	0.79	4.90	0.49	-1.67	0.30
过去六个月	13.89	0.74	8.65	0.45	5.24	0.29
过去一年	12.25	0.75	13.30	0.54	-1.05	0.21
过去三年	112.78	1.91	59.07	1.40	53.71	0.51
自基金合同生效 起至今	288.15	1.50	33.05	1.38	255.10	0.12

南方优选价值混合 H

阶段	净值增长 率 ① (%)	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 (%)
过去一个月	6.42	0.76	4.01	0.54	2.41	0.22
过去三个月	3.31	0.79	4.90	0.49	-1.59	0.30
过去六个月	13.89	0.75	8.65	0.45	5.24	0.30
自基金合同生效 起至今	10.04	0.75	10.22	0.53	-0.18	0.22

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

南方优选价值混合A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



南方优选价值混合H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



§ 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）管理资产规模超过 6,500 亿元，旗下管理 134 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		
罗安安	本基金基金经理	2015 年 7 月 10 日		7	清华大学计算机科学与技术专业博士，具有基金从业资格，2010 年 7 月加入南方基金，担任研究部高级研究员；2014 年 3 月至 2014 年 11 月，担任南方成长、南方价值基金经理助理；2014 年 11 月至 2015 年 7 月，担任投资经理；2015 年 7 月至今，任南方价值基金经理。
骆帅	本基金基金经理	2015 年 6 月 19 日		8	清华大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格，2009 年 7 月加入南方基金，担任研究部研究员、高级研究员；2014 年 3 月至 2015 年 5 月，任南方成份、南方安心基金经理助理；2015 年 5 月至今，任南方高端装备基金经理；2015 年 6 月至今，任南方价值、南方成长基金经理；2016 年 12 月至今，任南方绩优基金经理。

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《南方优选价值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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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 2 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

2017 年上半年，无论是宏观经济增长的质量还是持续时间都略超市场预期的。受益于基建投入增加预期，对冲了地产限购压制的影响。整个上游供给侧结构性改革的效用传导到中游机械、建材、航运，以及地产相关的家电、家居、白酒等大消费板块。即使是美国加息预期，流动性持续偏紧，也没有改变上证指数的方向。

报告期内，本基金看好房地产后续消费领域的景气以及相关龙头公司的业绩增长机会，重点布局了家居、家电等消费板块，获得了较好的回报。市场在追逐白马成长股的同时，我们还积极布局了一些相对独立的优秀成长个股，重点在电子、环保等板块加大配置。总体上，以估值安全边际叠加成长确定性的选股思路，帮助我们在上半年获得较好的收益，我们相信未来市场会不断分化，同时也会强化龙头公司的投资逻辑。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 级份额净值为 1.341 元，本报告期份额净值增长率为 13.89%，同

期业绩比较基准增长率为 8.65%；H 级份额净值为 1.342 元，本报告期份额净值增长率为 13.89%，同期业绩比较基准增长率为 8.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，宏观经济整体预计仍然保持平稳增长的可能性更大，叠加十九大的政治周期，央行持续宽松托底经济带来政策操作空间。即使上半年部分蓝筹股票已经涨幅较大，仍然存在结构性行情的机会。我们仍然维持结构分化是今年投资的主要特征之一，相信未来指数会继续分化，强者恒强的逻辑会进一步演化，并走向更极端。操作策略上维持在 80%左右的中性仓位，采取“仓位稳健，结构激进”的操作原则。我们会把更多精力用于个股选择上，精选业绩和估值具有向上弹性的标的，主要倾向于两类：一是，业绩增长持续估值偏低分红率高的白马股，以消费品、家电、高速公路等板块；二是，新兴成长里基本面景气改善且业绩能匹配估值的板块，比如新能源、特斯拉、苹果产业链、电商零售等。同时谨慎关注 PPI 和 CPI 的变化趋势，如果 CPI 出现显著上升，可能会强化流动性收紧的预期和供给侧结构性改革的放缓预期，可能会适当降低仓位。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每类基金份额的每年收益分配次数最多为 12 次，各基金份额类别全年分配比例不得低于该类基金份额年度可供分配收益的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金 A 类基金份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金

A 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；目前本基金 H 类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金 H 类基金份额可增加红利再投资的收益分配方式供 H 类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如 H 类基金份额持有人未选择，本基金 H 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；同一类别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。

本报告期内 2017 年 1 月 18 日已分配数（A 类每 10 份基金份额派发红利 1.85 元，H 类每 10 份基金份额派发红利 1.85 元）为以往年度收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方优选价值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，南方优选价值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优选价值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，南方优选价值混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 125,630,010.36 元。

5.3 托管人对本半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优选价值混合型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方优选价值混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	76,624,506.76	103,957,622.49
结算备付金	7,972,611.59	5,781,298.35
存出保证金	685,803.02	760,440.61
交易性金融资产	897,334,995.51	751,963,768.49
其中：股票投资	897,334,995.51	751,963,768.49
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	210,000,000.00	-
应收证券清算款	2,114,844.30	70,844,389.08
应收利息	-66,171.54	26,129.44
应收股利	-	-
应收申购款	3,212,782.94	206,976.11
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,197,879,372.58	933,540,624.57
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	6,807,837.22	-
应付赎回款	2,608,644.42	814,310.94
应付管理人报酬	1,436,039.00	1,181,667.40
应付托管费	239,339.81	196,944.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,100,890.17	3,020,856.17
应交税费	-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		204,598.96	394,839.92
负债合计		17,397,349.58	5,608,619.00
所有者权益：			
实收基金		879,999,180.14	678,133,937.45
未分配利润		300,482,842.86	249,798,068.12
所有者权益合计		1,180,482,023.00	927,932,005.57
负债和所有者权益总计		1,197,879,372.58	933,540,624.57

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 879,999,180.14 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 879,956,584.46 份，份额净值 1.341 元；H 类基金份额的份额总额为 42,595.68 份，份额净值 1.342 元。

6.2 利润表

会计主体：南方优选价值混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
一、收入	156,202,868.77		-192,237,142.72	
1. 利息收入	1,589,414.69		742,558.44	
其中：存款利息收入	737,776.08		742,558.44	
债券利息收入	-		-	
资产支持证券利息收入	-		-	
买入返售金融资产收入	851,638.61		-	
其他利息收入	-		-	
2. 投资收益（损失以“-”填列）	106,342,132.85		-128,714,048.45	
其中：股票投资收益	100,769,101.11		-130,881,273.55	
基金投资收益	-		-	
债券投资收益	-		-	
资产支持证券投资收益	-		-	
贵金属投资收益	-		-	
衍生工具收益	-		-	
股利收益	5,573,031.74		2,167,225.10	
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	48,039,330.88		-64,507,356.65	
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-		-	
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	231,990.35		241,703.94	
减：二、费用	19,433,479.68		22,071,385.72	

1. 管理人报酬		7,892,105.37	7,032,292.09
2. 托管费		1,315,350.90	1,172,048.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		10,023,205.86	13,658,563.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		202,817.55	208,481.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		136,769,389.09	-214,308,528.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		136,769,389.09	-214,308,528.44

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方优选价值混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 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）	678,133,937.45	249,798,068.12	927,932,005.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	136,769,389.09	136,769,389.09
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）	201,865,242.69	39,545,396.01	241,410,638.70
其中：1. 基金申购款	371,051,835.02	89,671,309.29	460,723,144.31
2. 基金赎回款	-169,186,592.33	-50,125,913.28	-219,312,505.61
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）	-	-125,630,010.36	-125,630,010.36
五、期末所有者	879,999,180.14	300,482,842.86	1,180,482,023.00

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
权益（基金净值）			
一、期初所有者权益（基金净值）	533,970,935.85	765,769,216.24	1,299,740,152.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-214,308,528.44	-214,308,528.44
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）	238,666,476.53	76,149,276.73	314,815,753.26
其中：1. 基金申购款	391,913,805.74	140,119,196.20	532,033,001.94
2. 基金赎回款	-153,247,329.21	-63,969,919.47	-217,217,248.68
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）	-	-328,186,030.17	-328,186,030.17
五、期末所有者权益（基金净值）	772,637,412.38	299,423,934.36	1,072,061,346.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 税项

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

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

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

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
华泰证券	-	-	1,159,247,966.70	12.78

6.4.5.1.2 权证交易

注：无。

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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(%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
华泰证券	1,056,423.86	12.71	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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

经手续费后的净额列示。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。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,892,105.37	7,032,292.09
其中：支付销售机构的客户维护费	1,193,483.60	1,128,444.36

注：支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,315,350.90	1,172,048.67

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 0.25% 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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	76,624,506.76	682,398.54	123,043,728.19	667,113.70

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。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.6 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300671	富满电子	2017年06月27日	2017-07-05	新股认购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603305	旭升股份	2017年06月30日	2017-07-10	新股认购	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年06月27日	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年06月23日	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017年06月28日	2017-07-06	新股认购	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
6.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
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)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.9.1.3 受限证券类别：权证										
证券	证券	成功	可流通	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估	备注

代码	名称	认购日	日	限类型	价格	值单价	(单位:	成本总	值总额	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.9.1.4 受限证券类别：基金

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:	期末成本总	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002669	康达新材	2017-04-21	重大事项	29.28	-	-	1,180,083	34,597,001.78	34,552,830.24	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03	12.70	790,644	9,817,224.30	9,954,207.96	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.24	2017-08-02	11.36	749,901	7,834,198.56	7,678,986.24	-

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。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 投资组合报告

7.1 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	897,334,995.51	74.91
	其中：股票	897,334,995.51	74.91
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	210,000,000.00	17.53
	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	84,597,118.35	7.06
-	其他各项资产	5,947,258.72	0.50
-	合计	1,197,879,372.58	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	723,366,025.91	61.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,441,045.61	1.39
E	建筑业	9,718,778.24	0.82
F	批发和零售业	41,658,265.31	3.53
G	交通运输、仓储和邮政业	8,540,000.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,503,566.14	1.91
J	金融业	68,214,036.70	5.78
K	房地产业	6,882,000.00	0.58
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,277.60	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	897,334,995.51	76.01

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	950,050	39,113,558.50	3.31
2	600036	招商银行	1,600,055	38,257,315.05	3.24
3	002008	大族激光	1,100,082	38,106,840.48	3.23
4	002635	安洁科技	1,050,050	38,032,811.00	3.22
5	600519	贵州茅台	75,000	35,388,750.00	3.00
6	002669	康达新材	1,180,083	34,552,830.24	2.93
7	601318	中国平安	600,056	29,768,778.16	2.52
8	600741	XD 华域汽	1,200,000	29,088,000.00	2.46
9	002241	歌尔股份	1,499,980	28,919,614.40	2.45
10	600176	中国巨石	2,600,033	28,548,362.34	2.42

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	000597	东北制药	68,533,305.68	7.39
2	000651	格力电器	66,766,072.83	7.20
3	600153	建发股份	58,872,980.81	6.34
4	600036	招商银行	57,241,033.72	6.17
5	002635	安洁科技	57,108,896.62	6.15
6	600741	华域汽车	56,413,578.43	6.08
7	300588	熙菱信息	53,295,619.54	5.74
8	300072	三聚环保	52,409,234.42	5.65
9	300577	开润股份	50,472,041.36	5.44

10	002241	歌尔股份	49,585,458.36	5.34
11	600116	三峡水利	48,289,011.33	5.20
12	600886	国投电力	47,843,745.76	5.16
13	002008	大族激光	47,378,078.87	5.11
14	000786	北新建材	46,448,058.14	5.01
15	300418	昆仑万维	42,942,209.92	4.63
16	601919	中远海控	42,506,814.02	4.58
17	603626	科森科技	42,062,970.87	4.53
18	600196	复星医药	41,137,961.81	4.43
19	002415	海康威视	39,557,115.68	4.26
20	600409	三友化工	39,267,903.83	4.23
21	600703	三安光电	39,011,008.86	4.20
22	000881	中广核技	37,417,664.65	4.03
23	000429	粤高速 A	36,026,436.95	3.88
24	002669	康达新材	35,183,350.40	3.79
25	300571	平治信息	33,455,187.13	3.61
26	002322	理工环科	32,891,838.49	3.54
27	000333	美的集团	32,830,193.85	3.54
28	300038	梅泰诺	32,599,812.87	3.51
29	300197	铁汉生态	30,622,215.47	3.30
30	601628	中国人寿	28,979,436.52	3.12
31	600779	水井坊	28,855,487.39	3.11
32	000661	长春高新	28,517,148.39	3.07
33	600519	贵州茅台	27,774,196.02	2.99
34	603528	多伦科技	27,719,163.05	2.99
35	300138	晨光生物	27,501,377.10	2.96
36	600176	中国巨石	27,382,413.53	2.95
37	601318	中国平安	27,077,033.89	2.92
38	600977	中国电影	27,061,891.04	2.92
39	600585	海螺水泥	26,785,717.89	2.89
40	002185	华天科技	26,578,446.49	2.86
41	600309	万华化学	26,140,815.52	2.82
42	000425	徐工机械	25,599,445.97	2.76
43	600343	航天动力	25,414,164.52	2.74
44	300463	迈克生物	24,892,439.05	2.68
45	600004	白云机场	23,927,886.48	2.58
46	600419	天润乳业	23,698,059.79	2.55
47	600335	国机汽车	23,170,565.73	2.50
48	600702	沱牌舍得	23,004,106.82	2.48
49	600068	葛洲坝	22,988,995.81	2.48
50	000700	模塑科技	22,988,025.76	2.48
51	000968	*ST 煤气	22,462,999.85	2.42

52	002739	万达院线	21,163,664.00	2.28
53	002812	创新股份	20,801,853.00	2.24
54	300296	利亚德	20,186,459.90	2.18
55	300336	新文化	20,171,156.75	2.17
56	000858	五粮液	19,683,269.55	2.12
57	600425	*ST 青松	19,165,833.62	2.07
58	002217	合力泰	19,041,357.49	2.05

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	002572	索菲亚	90,055,924.14	9.71
2	300072	三聚环保	81,440,779.34	8.78
3	000881	中广核技	77,024,601.71	8.30
4	000065	北方国际	61,799,533.21	6.66
5	000597	东北制药	60,671,077.74	6.54
6	000820	金城股份	57,584,451.03	6.21
7	002415	海康威视	57,260,800.09	6.17
8	002508	老板电器	56,971,427.93	6.14
9	600409	三友化工	51,052,046.06	5.50
10	300588	熙菱信息	49,723,588.93	5.36
11	600886	国投电力	47,693,566.94	5.14
12	601919	中远海控	42,358,271.17	4.56
13	600153	建发股份	42,326,290.53	4.56
14	300232	洲明科技	41,602,891.41	4.48
15	000651	格力电器	40,048,272.51	4.32
16	600419	天润乳业	39,160,310.17	4.22
17	300197	铁汉生态	37,857,118.25	4.08
18	000661	长春高新	37,847,142.28	4.08
19	600741	华域汽车	37,360,183.25	4.03
20	300571	平治信息	34,944,001.73	3.77
21	600116	三峡水利	33,256,185.59	3.58
22	000429	粤高速 A	32,242,366.06	3.47
23	300038	梅泰诺	31,787,733.42	3.43
24	000963	华东医药	31,664,704.28	3.41
25	000333	美的集团	31,160,958.85	3.36
26	000786	北新建材	29,532,181.00	3.18
27	300577	开润股份	29,012,676.20	3.13

28	300202	聚龙股份	28,772,857.18	3.10
29	601628	中国人寿	28,522,648.63	3.07
30	600036	招商银行	28,076,416.86	3.03
31	002120	新海股份	27,891,035.98	3.01
32	600779	水井坊	27,673,983.97	2.98
33	002241	歌尔股份	27,064,191.34	2.92
34	300188	美亚柏科	26,053,909.77	2.81
35	300418	昆仑万维	25,775,996.04	2.78
36	600309	万华化学	25,714,353.96	2.77
37	000425	徐工机械	25,713,821.00	2.77
38	600977	中国电影	25,711,123.99	2.77
39	600343	航天动力	25,321,040.73	2.73
40	300104	乐视网	25,253,239.23	2.72
41	002185	华天科技	25,214,300.27	2.72
42	000565	渝三峡 A	24,688,089.62	2.66
43	600004	白云机场	24,310,581.05	2.62
44	600703	三安光电	23,917,483.44	2.58
45	000968	*ST 煤气	23,582,691.49	2.54
46	000700	模塑科技	23,465,720.35	2.53
47	603528	多伦科技	23,367,063.00	2.52
48	002635	安洁科技	23,337,173.13	2.51
49	300145	中金环境	23,278,396.62	2.51
50	600068	葛洲坝	22,554,545.94	2.43
51	002456	欧菲光	22,230,753.80	2.40
52	300496	中科创达	22,159,564.60	2.39
53	002511	中顺洁柔	21,733,428.57	2.34
54	002739	万达院线	21,454,529.78	2.31
55	300115	长盈精密	21,452,800.96	2.31
56	600702	沱牌舍得	21,058,862.18	2.27
57	600598	北大荒	19,837,230.03	2.14
58	000568	泸州老窖	19,547,742.46	2.11
59	300258	精锻科技	19,542,711.73	2.11
60	603626	科森科技	19,336,834.33	2.08
61	300296	利亚德	19,159,651.27	2.06
62	002127	南极电商	18,591,067.14	2.00

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

7.4.3 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	3,328,385,744.58
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	3,331,822,949.55
--------------	------------------

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.12.3 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	685,803.02
2	应收证券清算款	2,114,844.30
3	应收股利	-

4	应收利息	-66,171.54
5	应收申购款	3,212,782.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	其他	-
-	合计	5,947,258.72

7.12.4 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。

7.12.5 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	002669	康达新材	34,552,830.24	2.93	重大事项

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
南方优选价值混合	72,863	12,076.86	77,923,770.67	8.86	802,032,813.79	91.14
南方优选价值混合 H	1	42,595.68	42,595.68	100.00	0.00	0.00
合计	72,864	12,077.28	77,966,366.35	8.86	802,032,813.79	91.14

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	南方优选价值混合 A	1,904,066.61	0.2164
	南方优选价值混合 H	-	-
	合计	1,904,066.61	0.2164

注：：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	南方优选价值混合 A	50~100
	南方优选价值混合 H	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方优选价值混合 A	10~50
	南方优选价值混合 H	-
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方优选价值混合 A	南方优选价值混合 H
基金合同生效日（2008 年 6 月 18 日）基金份额总额	1,139,765,865.76	
本报告期期初基金份额总额	678,099,131.95	34,805.50
本报告期基金总申购份额	371,044,044.84	7,790.18
减：本报告期基金总赎回份额	169,186,592.33	-
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	879,956,584.46	42,595.68

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议已于 2017 年 1 月 23 日审议通过了《公司关于聘任公司副总经理、督察长和财务负责人的议案》，秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 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 (%)	
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	437,152,395.77	6.57	398,378.03	6.53	-
国泰君安	2	269,321,561.30	4.05	245,432.97	4.02	-
国信证券	1	530,035,523.44	7.96	483,023.32	7.92	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	695,960,255.81	10.46	642,483.33	10.53	-
华融证券	1	1,078,410,827.88	16.20	982,757.09	16.11	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	765,055,211.00	11.49	697,195.53	11.43	-
上海证券	1	882,557,759.86	13.26	804,276.20	13.18	-
申万宏源	2	377,076,046.23	5.67	350,013.07	5.74	-

西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	282,728,232.11	4.25	257,649.84	4.22	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	195,357,381.36	2.93	178,029.87	2.92	-
招商证券	1	1,142,518,472.53	17.16	1,061,650.92	17.40	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	1,900,000.00	37.04	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	1,000,000.00	19.49	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	2,230,000.00	43.47	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-