

南方量化成长股票型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

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	南方量化成长股票
基金主代码	001421
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	957,008,237.78 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“南方量化成长”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

注：-

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95566
传真	0755-82763889	010-66594942

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	报告期（2017年1月1日-2017年6月30日）
本期已实现收益	-187,733,690.01
本期利润	-142,686,770.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1348
本期基金份额净值增长率	-10.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.1598
期末基金资产净值	1,109,934,578.85
期末基金份额净值	1.160

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	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	3.11	0.95	4.87	0.84	-1.76	0.11
过去三个月	-9.66	1.03	-3.67	0.92	-5.99	0.11
过去六个月	-10.84	0.96	-1.72	0.81	-9.12	0.15
过去一年	-1.36	0.92	0.48	0.82	-1.84	0.10
自基金合同 生效起至今	16.00	1.86	-28.42	1.97	44.42	-0.11

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

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		
雷俊	本基金基金经理	2015 年 6 月 29 日		9	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。
--	--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方量化成长股票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。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。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或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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

报告期内，本基金选股策略以量化多因子模型选股为主，充分借助南方大数据量化平台的研究成果，有效整合了传统多因子研究的模型和大数据模型，根据融合模型进行股票投资；另外，实际结合期货的升贴水情况和基金的流动性要求，也有参与部分期货投资。

本季度市场上涨股票聚集度较高，中小市值的新兴行业股票则表现低迷，同时受市场广度影响量化策略表现低于预期；经过前期调整部分成长股已经有不错的投资机会，后续产品运作将在坚持原有投资风格基础上，完善和改进量化策略，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 1.160 元；报告期内，基金份额净值增长率为-10.84%，同期业绩基准增长率为-1.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济角度看，物价上行压力舒缓，经济下行压力不大，出于对资产泡沫的抑制和监管政策的持续推进，货币政策将持续处于偏紧态势，去杠杆所带来的资金动向会扩散到 A 股市场，预计下半年证券市场仍旧是以存量博弈为主。

从基本面看 A 股大小市值股票的估值对比，大股票的优势在缩小，龙头行业的趋势可能会改变；预计有更多的行业和板块迎来结构性行情，一些基本面良好、业绩增速好和低估值的个股和子行业会有不错的投资机会。

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、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利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；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南方量化成长股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：南方量化成长股票型证券投资基金

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	34,431,354.80	38,973,221.24
结算备付金	50,642,658.97	192,683,499.84
存出保证金	21,987,298.63	23,102,590.24
交易性金融资产	913,153,611.28	1,053,139,871.91
其中：股票投资	912,606,640.42	1,053,139,871.91
基金投资	-	-
债券投资	546,970.86	-
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	120,000,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	-15,630.64	26,947.85
应收股利	-	-
应收申购款	903,752.98	7,861,232.26
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,141,103,046.02	1,315,787,363.34
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	9,716,835.61	11,375,227.68
应付赎回款	11,753,012.31	4,817,906.47
应付管理人报酬	1,378,618.38	1,584,422.46
应付托管费	229,769.75	264,070.41
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,859,006.90	2,858,303.05
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	231,224.22	261,078.93
负债合计	31,168,467.17	21,161,009.00
所有者权益：		
实收基金	957,008,237.78	995,073,246.96
未分配利润	152,926,341.07	299,553,107.38
所有者权益合计	1,109,934,578.85	1,294,626,354.34
负债和所有者权益总计	1,141,103,046.02	1,315,787,363.34

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.160 元，基金份额总额 957,008,237.78 份。

6.2 利润表

会计主体：南方量化成长股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	-117,488,352.96	-1,734,732.96
1. 利息收入	2,282,642.65	201,394.31
其中：存款利息收入	1,067,594.79	199,392.92
债券利息收入	72.68	-
资产支持证券 利息收入	-	-
买入返售金融 资产收入	1,214,975.18	2,001.39
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）	-167,533,707.38	5,844,970.15
其中：股票投资收益	-174,033,698.43	7,042,974.79
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	2,333,390.64	-2,076,920.00
股利收益	4,166,600.41	878,915.36
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填	45,046,919.02	-8,097,252.23

列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	2,715,792.75	316,154.81
减: 二、费用	25,198,418.03	5,502,047.27
1. 管理人报酬	9,832,728.85	1,690,079.99
2. 托管费	1,638,788.14	281,679.93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,512,331.42	3,346,388.25
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	214,569.62	183,899.10
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-142,686,770.99	-7,236,780.23
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-142,686,770.99	-7,236,780.23

注: -

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 南方量化成长股票型证券投资基金

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)	995,073,246.96	299,553,107.38	1,294,626,354.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	-142,686,770.99	-142,686,770.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-38,065,009.18	-3,939,995.32	-42,005,004.50
其中: 1. 基金申购款	665,798,375.88	188,161,328.15	853,959,704.03

2. 基金赎回款	-703,863,385.06	-192,101,323.47	-895,964,708.53
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）	957,008,237.78	152,926,341.07	1,109,934,578.85
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
一、期初所有者权益（基金净值）	200,917,883.43	46,176,528.19	247,094,411.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-7,236,780.23	-7,236,780.23
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）	-1,521,661.50	-3,822,623.87	-5,344,285.37
其中：1. 基金申购款	93,079,494.56	4,857,612.36	97,937,106.92
2. 基金赎回款	-94,601,156.06	-8,680,236.23	-103,281,392.29
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）	199,396,221.93	35,117,124.09	234,513,346.02

注：-

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、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、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
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

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 (%)
兴业证券	1,146,940,157.53	12.81	563,465,976.03	25.67

6.4.5.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	480,600.00	100.00	-	-

6.4.5.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.5.1.4 基金交易

注：无。

6.4.5.1.5 权证交易

注：无。

6.4.5.1.6 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 (%)
兴业证券	1,045,210.00	12.76	1,045,210.00	13.30
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 (%)
兴业证券	513,487.68	25.48	513,487.68	26.62

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	9,832,728.85	1,690,079.99
其中：支付销售机构的客户维护费	3,027,071.69	565,021.58

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。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,638,788.14	281,679.93

注：支付基金托管人中国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 X 0.25% / 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	34,431,354.80	230,695.26	7,900,361.69	91,499.76

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国银行保管，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。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

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

6.4.12.1.1 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)	期末成本总额	期末估值总额	备注

002879	长缆科技	2017年 06月 05日	2017- 07-07	新股认购	18.02	18.02	1,313	23,660.2 6	23,660.2 6	-
002882	金龙羽	2017年 06月 15日	2017- 07-17	新股认购	6.20	6.20	2,966	18,389.2 0	18,389.2 0	-
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	15,212.2 6	15,212.2 6	-
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	17,311.4 0	17,311.4 0	-

6.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.1.3 受限证券类别：权证

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.1.4 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 成本总额	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
30042 3	鲁亿通	2017- 02-27	重大资 产重组	33.95	2017- 07-31	30.56	254,02 9	7,845,98 7.63	8,624,28 4.55	-
30048	东杰智	2017-	重大资	22.63	2017-	20.38	297,25	7,142,25	6,726,88	-

6	能	01-25	产重组		08-09		5	1.76	0.65	
300414	中光防雷	2017-04-28	重大资产重组	24.78	-	-	235,500	7,331,182.93	5,835,690.00	
600136	当代明诚	2017-02-13	重大资产重组	16.79	-	-	339,100	5,635,957.23	5,693,489.00	
002787	华源控股	2017-03-22	重大事项	18.91	-	-	281,600	5,133,065.72	5,325,056.00	
300209	天泽信息	2017-02-10	重大资产重组	27.72	-	-	187,600	5,029,838.23	5,200,272.00	
000673	当代东方	2017-01-18	重大资产重组	13.53	2017-08-22	12.18	299,800	4,082,991.65	4,056,294.00	
300092	科新机电	2017-04-14	重大资产重组	12.70	-	-	308,055	4,179,826.28	3,912,298.50	
002621	三垒股份	2017-05-09	重大资产重组	15.19	-	-	225,039	3,933,475.67	3,418,342.41	
600568	中珠医疗	2017-04-25	重大资产重组	19.16	2017-07-27	6.15	173,800	3,348,502.46	3,330,008.00	
600657	信达地产	2017-02-20	重大资产重组	5.76	2017-08-10	6.19	560,100	3,337,839.34	3,226,176.00	
000506	中润资源	2017-04-25	重大资产重组	8.75	-	-	344,500	3,253,657.20	3,014,375.00	
300163	先锋新材	2017-04-26	重大资产重组	7.60	-	-	384,500	3,247,536.46	2,922,200.00	
002693	双成药业	2017-05-25	重大资产重组	6.67	2017-07-25	6.88	331,800	2,655,896.00	2,213,106.00	
002796	世嘉科技	2017-06-05	重大资产重组	31.50	2017-8-23	34.65	63,600	2,410,794.00	2,003,400.00	
600127	金健米业	2017-06-30	重要事项未公告	5.64	2017-07-14	5.79	319,700	1,821,383.81	1,803,108.00	
603598	引力传媒	2017-05-10	重大资产重组	16.21	-	-	109,055	1,873,511.70	1,767,781.55	
002729	好利来	2017-05-25	重大资产重组	69.04	2017-08-18	62.06	24,307	1,905,097.75	1,678,155.28	
600057	象屿股份	2017-06-27	重要事项未公告	10.17	2017-07-04	10.17	137,200	1,388,017.51	1,395,324.00	
300478	杭州高新	2017-03-20	重大资产重组	55.60	2017-08-07	50.04	16,400	884,289.78	911,840.00	

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

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	912,606,640.42	79.98
	其中：股票	912,606,640.42	79.98
2	固定收益投资	546,970.86	0.05
	其中：债券	546,970.86	0.05
	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	120,000,000.00	10.52
	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	85,074,013.77	7.46
7	其他各项资产	22,875,420.97	2.00
8	合计	1,141,103,046.02	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	12,342,014.04	1.11
B	采矿业	21,527,900.24	1.94
C	制造业	585,416,304.79	52.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,234,583.39	3.17
E	建筑业	14,501,703.36	1.31
F	批发和零售业	43,411,299.74	3.91
G	交通运输、仓储和邮政业	17,149,273.00	1.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,924,472.09	7.83
J	金融业	22,633,129.40	2.04
K	房地产业	32,390,793.00	2.92
L	租赁和商务服务业	4,505,115.55	0.41
M	科学研究和技术服务业	3,389,446.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	8,206,320.00	0.74
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	17,978,995.00	1.62
S	综合	6,995,290.82	0.63
	合计	912,606,640.42	82.22

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	002518	科士达	1,018,740	14,893,978.80	1.34
2	300129	泰胜风能	2,065,648	14,645,444.32	1.32
3	300248	新开普	763,700	12,349,029.00	1.11
4	300064	豫金刚石	1,101,696	11,457,638.40	1.03
5	002380	科远股份	614,785	11,342,783.25	1.02
6	300138	晨光生物	835,392	10,960,343.04	0.99
7	002372	伟星新材	566,887	10,589,449.16	0.95

8	002714	牧原股份	386,832	10,529,567.04	0.95
9	300184	力源信息	846,400	10,529,216.00	0.95
10	002421	达实智能	1,720,200	10,527,624.00	0.95

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	002536	西泵股份	30,131,558.83	2.33
2	002043	兔宝宝	26,795,291.47	2.07
3	300184	力源信息	26,305,219.84	2.03
4	300310	宜通世纪	24,383,975.98	1.88
5	300342	天银机电	24,193,892.79	1.87
6	002597	金禾实业	23,881,629.89	1.84
7	600176	中国巨石	23,665,265.78	1.83
8	600973	宝胜股份	19,736,610.29	1.52
9	002518	科士达	17,948,895.72	1.39
10	002380	科远股份	17,834,575.63	1.38
11	300064	豫金刚石	16,711,156.32	1.29
12	300218	安利股份	16,526,388.36	1.28
13	300468	四方精创	16,231,878.88	1.25
14	300220	金运激光	15,705,534.38	1.21
15	002760	凤形股份	15,581,466.64	1.20
16	300442	普丽盛	15,486,025.78	1.20
17	000002	万科 A	15,107,840.63	1.17
18	300387	富邦股份	15,025,432.81	1.16
19	300018	中元股份	14,849,732.31	1.15
20	603936	博敏电子	14,553,123.56	1.12

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	300342	天银机电	25,721,173.20	1.99
2	600176	中国巨石	24,378,795.51	1.88
3	300310	宜通世纪	24,272,109.34	1.87
4	002597	金禾实业	22,240,479.15	1.72
5	002536	西泵股份	20,891,467.91	1.61
6	002352	顺丰控股	18,906,909.61	1.46

7	300468	四方精创	16,873,849.75	1.30
8	600973	宝胜股份	16,636,471.39	1.29
9	002043	兔宝宝	15,843,542.80	1.22
10	300220	金运激光	15,137,350.69	1.17
11	000002	万科 A	15,117,588.11	1.17
12	300365	恒华科技	15,017,877.70	1.16
13	601238	广汽集团	14,474,051.15	1.12
14	603936	博敏电子	14,192,667.45	1.10
15	002760	凤形股份	14,126,994.51	1.09
16	002540	亚太科技	14,014,368.49	1.08
17	300442	普丽盛	13,782,924.88	1.06
18	300114	中航电测	13,623,798.33	1.05
19	002452	长高集团	13,469,128.06	1.04
20	300277	海联讯	13,351,319.06	1.03

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	4,476,226,904.87
卖出股票收入（成交）总额	4,482,840,176.73

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	546,970.86	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	546,970.86	0.05

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128015	久其转债	4,806	546,970.86	0.05

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**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC1707	IC1707	89	108,633,400.00	3,615,931.56	-
公允价值变动总额合计(元)					3,615,931.56
股指期货投资本期收益(元)					2,333,390.64
股指期货投资本期公允价值变动(元)					4,866,809.36

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

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	21,987,298.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-15,630.64
5	应收申购款	903,752.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
-	其他	-
-	合计	22,875,420.97

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 股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

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 (%)
69,067	13,856.23	41,584,759.44	4.35	915,423,478.34	95.65

8.2 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	844,741.00	0.0883

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 6 月 29 日) 基金份额总额	481,169,673.62
本报告期期初基金份额总额	995,073,246.96
本报告期基金总申购份额	665,798,375.88
减：本报告期基金总赎回份额	703,863,385.06

本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	957,008,237.78

§ 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 (%)	
天风证券	1	2,010,730,892.59	22.45	1,832,386.48	22.37	-
长江证券	1	1,526,573,099.94	17.05	1,391,172.43	16.99	-

兴业证券	1	1,146,940,157.53	12.81	1,045,210.00	12.76	-
英大证券	1	1,135,013,450.37	12.68	1,046,393.88	12.78	-
长城证券	1	680,362,743.89	7.60	620,016.75	7.57	-
广发证券	2	609,061,963.66	6.80	562,139.94	6.86	-
东吴证券	1	449,076,971.35	5.01	409,244.56	5.00	-
西部证券	1	408,875,872.99	4.57	372,610.12	4.55	-
中银国际	1	308,049,198.26	3.44	280,728.16	3.43	-
民生证券	1	288,553,688.20	3.22	268,731.41	3.28	-
申万宏源	1	183,191,035.24	2.05	170,605.26	2.08	-
国信证券	1	162,728,281.44	1.82	148,295.23	1.81	-
中信建投	2	27,297,987.78	0.30	25,422.83	0.31	-
中信证券	2	18,008,944.00	0.20	16,411.76	0.20	-
广州证券	1	223,130.59	0.00	203.38	0.00	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

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

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 (%)
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	1,170,000,000.00	16.15	-	-	-	-
广州证券	-	-	535,000,000.00	7.38	-	-	-	-
国信证券	-	-	970,000,000.00	13.39	-	-	-	-
华泰证券	480,600.00	100.00	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	850,000,000.00	11.73	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	2,560,000,000.00	35.33	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	860,000,000.00	11.87	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	300,000,000.00	4.14	-	-	-	-