

南方量化成长股票型证券投资基金 2017 年半年度报告

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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录

- 1.1 重要提示
- 1.2 目录

§2 基金简介

- 2.1 基金基本情况
- 2.2 基金产品说明
- 2.3 基金管理人和基金托管人
- 2.4 信息披露方式
- 2.5 其他相关资料

§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
- 3.2 基金净值表现
- 3.3 其他指标

§4 管理人报告

- 4.1 基金管理人及基金经理情况
- 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明
- 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
- 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
- 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
- 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
- 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
- 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

§5 托管人报告

- 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明
- 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
- 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

- 6.1 资产负债表
- 6.2 利润表
- 6.3 所有者权益（基金净值）变动表
- 6.4 报表附注

§7 投资组合报告

- 7.1 期末基金资产组合情况
- 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 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
- 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

- 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
- 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
- 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
- 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
- 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
- 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 7.12 投资组合报告附注

§ 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
- 8.2 期末上市基金前十名持有人
- 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
- 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况
- 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

§ 9 开放式基金份额变动

§ 10 重大事件揭示

- 10.1 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
- 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
- 10.4 基金投资策略的改变
- 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
- 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
- 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
- 10.8 其他重大事件

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

- 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况
- 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 12 备查文件目录

- 12.1 备查文件目录
- 12.2 存放地点
- 12.3 查阅方式

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方量化成长股票型证券投资基金
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	王永民
	联系电话	0755-82763888	010-66594896
	电子邮箱	manager@southernfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95566
传真		0755-82763889	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 号
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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		张海波	田国立

注：-

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网	http://www.nffund.com

网址	
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

注：-

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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
本期加权平均净值利润率	-10.80%
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）
期末可供分配利润	152,926,341.07
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	16.00%

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

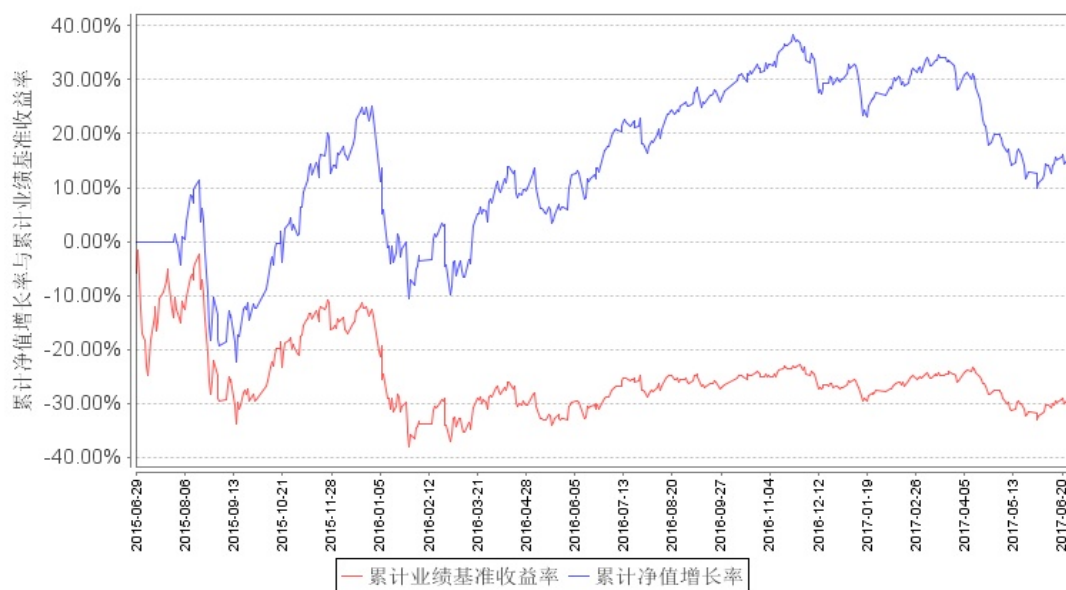
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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、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	附注号	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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	120,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	-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	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,141,103,046.02	1,315,787,363.34
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	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	6.4.7.9	957,008,237.78	995,073,246.96
未分配利润	6.4.7.10	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	附注号	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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	-174,033,698.43	7,042,974.79
基金投资 收益	6.4.7.13	-	-
债券投资 收益	6.4.7.14	-	-
资产支持 证券投资收益	6.4.7.14 .5	-	-
贵金属投 资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具 收益	6.4.7.16	2,333,390.64	-2,076,920.00
股利收益	6.4.7.17	4,166,600.41	878,915.36
3. 公允价值变动 收益（损失以“- ”号填列）	6.4.7.18	45,046,919.02	-8,097,252.23
4. 汇兑收益（损 失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损 失以“-”号填列）	6.4.7.19	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	6.4.10.2 .1	9,832,728.85	1,690,079.99

2. 托管费	6.4.10.2 .2	1,638,788.14	281,679.93
3. 销售服务费	6.4.10.2 .3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	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	6.4.7.21	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 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	34,431,354.80
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 1 个月以内	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	34,431,354.80

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	902,813,066.70	912,606,640.42	9,793,573.72
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-
债券	交易所市场	480,600.00	546,970.86
	银行间市场	-	-
	合计	480,600.00	546,970.86
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	903,293,666.70	913,153,611.28	9,859,944.58

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	105,017,468.44	-	-	-
IC1707	105,017,468.44	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	105,017,468.44	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清

算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 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 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	120,000,000.00	-
合计	120,000,000.00	-

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	6,913.69
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	23,025.37
应收债券利息	72.68
应收买入返售证券利息	-45,747.95
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	105.57
合计	-15,630.64

6.4.4.6 其他资产

注：：无。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,859,006.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,859,006.90

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	32,869.94
预提费用	198,354.28
其他	-
应付指数使用费	-
应退替代款	-
可退替代款	-
合计	231,224.22

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	995,073,246.96	995,073,246.96
本期申购	665,798,375.88	665,798,375.88
本期赎回（以“-”号填列）	-703,863,385.06	-703,863,385.06
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	957,008,237.78	957,008,237.78

注：：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.4.10 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	385,468,599.36	-85,915,491.98	299,553,107.38
本期利润	-187,733,690.01	45,046,919.02	-142,686,770.99
本期基金份额交易产生的变动数	-8,071,753.95	4,131,758.63	-3,939,995.32
其中：基金申购款	234,276,360.96	-46,115,032.81	188,161,328.15
基金赎回款	-242,348,114.91	50,246,791.44	-192,101,323.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	189,663,155.40	-36,736,814.33	152,926,341.07

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日

活期存款利息收入	230,695.26
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	827,288.78
其他	9,610.75
合计	1,067,594.79

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	4,482,840,176.73
减：卖出股票成本总额	4,656,873,875.16
买卖股票差价收入	-174,033,698.43

6.4.4.13 基金投资收益

注：无。

6.4.4.14 债券投资收益

注：无。

6.4.4.14.1 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.16 衍生工具收益

6.4.4.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.4.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货-投资收益	2,333,390.64

6.4.4.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,166,600.41
基金投资产生的股利收益	-

合计	4,166,600.41
----	--------------

6.4.4.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	40,180,109.66
股票投资	40,113,738.80
债券投资	66,370.86
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	4,866,809.36
权证投资	-
期货	4,866,809.36
其他	-
合计	45,046,919.02

6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	2,399,783.30
补差费归资产	316,009.45
合计	2,715,792.75

6.4.4.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	13,512,331.42
银行间市场交易费用	-
合计	13,512,331.42

6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行费用	16,215.34
合计	214,569.62

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 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

6.4.7.1.2 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	-	-

6.4.7.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.7.1.4 基金交易

注：无。

6.4.7.1.5 权证交易

注：无。

6.4.7.1.6 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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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
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。

6.4.7.2.2 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况

注：：无。

6.4.9 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年06月15日	2017-07-17	新股认购	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
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	-
6.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.9.2 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
300423	鲁亿通	2017-02-27	重大资产重组	33.95	2017-07-31	30.56	254,029	7,845,987.63	8,624,284.55	
300486	东杰智能	2017-01-25	重大资产重组	22.63	2017-08-09	20.38	297,255	7,142,251.76	6,726,880.65	
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	10.17	2017-07-04	10.17	137,200	1,388,017.51	1,395,324.00	

			告							
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	

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金。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。

6.4.10.2 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中国银行，因而与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，且通过分散化投资以分散信用风险。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。

6.4.10.3 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。本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.9 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，其余均能以合理价格适时变现。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。于 2017 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,431,354.80	-	-	-	34,431,354.80
结算备付金	50,642,658.97	-	-	-	50,642,658.97
存出保证金	21,987,298.63	-	-	-	21,987,298.63
交易性金融资产	546,970.86	-	-	912,606,640.42	913,153,611.28
买入返售金融资产	120,000,000.00	-	-	-	120,000,000.00
应收利息	-	-	-	-15,630.64	-15,630.64
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	903,752.98	-	-	-	903,752.98
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	228,512,036.24	-	-	912,591,009.78	1,141,103,046.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,753,012.31	11,753,012.31
应付管理人报酬	-	-	-	-1,378,618.38	1,378,618.38
应付托管费	-	-	-	229,769.75	229,769.75
应付证券清算款	-	-	-	-9,716,835.61	9,716,835.61
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-7,859,006.90	7,859,006.90
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-231,224.22	231,224.22
负债总计	-	-	-	-31,168,467.17	31,168,467.17
利率敏感度缺口	228,512,036.24	-	-	-881,422,542.61	1,109,934,578.85
上年度末 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	38,973,221.24	-	-	-	38,973,221.24
结算备付金	192,683,499.84	-	-	-	192,683,499.84
存出保证金	471,982.24	-	-	-22,630,608.00	23,102,590.24
交易性金融资产	-	-	-	-1,053,139,871.91	1,053,139,871.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-26,947.85	26,947.85
应收申购款	3,572,493.68	-	-	-4,288,738.58	7,861,232.26
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	235,701,197.00	-	-	-1,080,086,166.34	1,315,787,363.34
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-11,375,227.68	11,375,227.68
应付赎回款	-	-	-	-4,817,906.47	4,817,906.47
应付管理人报酬	-	-	-	-1,584,422.46	1,584,422.46
应付托管费	-	-	-	-264,070.41	264,070.41
应付交易费用	-	-	-	-2,858,303.05	2,858,303.05
其他负债	-	-	-	-261,078.93	261,078.93
负债总计	-	-	-	-21,161,009.00	21,161,009.00
利率敏感度缺口	235,701,197.00	-	-	-1,058,925,157.34	1,294,626,354.34

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金

资产净值无重大影响。

6.4.10.4.2 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，股票投资比例为基金资产的 80%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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。

6.4.10.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	912,606,640.42	82.22	1,053,139,871.91	81.35
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	912,606,640.42	82.22	1,053,139,871.91	81.35

注：-

6.4.10.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 7,143	增加约 5,527
	2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 7,143	减少约 5,527

6.4.11 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	-	-

	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（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
11	002536	西泵股份	830,378	10,280,079.64	0.93
12	300166	东方国信	763,845	10,258,438.35	0.92
13	000967	盈峰环境	945,912	10,253,686.08	0.92
14	002171	楚江新材	682,073	10,115,142.59	0.91
15	002706	良信电器	823,023	9,777,513.24	0.88
16	300231	银信科技	729,300	9,626,760.00	0.87
17	300316	晶盛机电	770,357	9,621,758.93	0.87
18	300203	聚光科技	341,500	9,602,980.00	0.87
19	002091	江苏国泰	1,003,533	9,583,740.15	0.86
20	300160	秀强股份	1,062,857	9,533,827.29	0.86
21	300018	中元股份	1,080,160	9,494,606.40	0.86
22	300362	天翔环境	556,739	9,492,399.95	0.86
23	300010	立思辰	726,000	9,401,700.00	0.85
24	002279	久其软件	744,865	9,348,055.75	0.84
25	002329	皇氏集团	971,500	9,336,115.00	0.84
26	300423	鲁亿通	254,029	8,624,284.55	0.78
27	002043	兔宝宝	598,000	8,276,320.00	0.75
28	300247	乐金健康	1,188,800	7,917,408.00	0.71
29	600131	岷江水电	893,900	7,222,712.00	0.65
30	600081	东风科技	555,291	6,913,372.95	0.62
31	300266	兴源环境	223,200	6,856,704.00	0.62
32	600644	乐山电力	897,217	6,809,877.03	0.61
33	601866	中远海发	1,871,100	6,735,960.00	0.61
34	300486	东杰智能	297,255	6,726,880.65	0.61
35	300360	炬华科技	440,013	6,622,195.65	0.60
36	600052	浙江广厦	1,310,500	6,618,025.00	0.60
37	000531	穗恒运 A	686,018	6,530,891.36	0.59
38	601636	旗滨集团	1,440,400	6,496,204.00	0.59
39	300339	润和软件	501,500	6,318,900.00	0.57
40	000055	方大集团	859,000	6,253,520.00	0.56
41	002078	太阳纸业	842,100	6,189,435.00	0.56
42	600015	华夏银行	658,920	6,075,242.40	0.55
43	002285	世联行	741,700	5,948,434.00	0.54
44	601169	北京银行	638,000	5,850,460.00	0.53
45	000001	平安银行	622,900	5,849,031.00	0.53

46	300414	中光防雷	235,500	5,835,690.00	0.53
47	300232	洲明科技	360,200	5,763,200.00	0.52
48	600136	当代明诚	339,100	5,693,489.00	0.51
49	000626	远大控股	300,900	5,596,740.00	0.50
50	002094	青岛金王	251,583	5,366,265.39	0.48
51	002787	华源控股	281,600	5,325,056.00	0.48
52	300327	中颖电子	166,300	5,271,710.00	0.47
53	000070	特发信息	447,200	5,254,600.00	0.47
54	300209	天泽信息	187,600	5,200,272.00	0.47
55	000609	绵石投资	348,907	5,191,736.16	0.47
56	002081	金螳螂	472,082	5,183,460.36	0.47
57	002172	澳洋科技	644,070	5,178,322.80	0.47
58	300026	红日药业	1,090,800	5,137,668.00	0.46
59	000498	山东路桥	711,100	5,084,365.00	0.46
60	600229	城市传媒	537,200	5,033,564.00	0.45
61	300204	舒泰神	320,900	5,002,831.00	0.45
62	002394	联发股份	338,900	4,991,997.00	0.45
63	600117	西宁特钢	990,100	4,990,104.00	0.45
64	002293	罗莱生活	433,900	4,972,494.00	0.45
65	002367	康力电梯	424,900	4,962,832.00	0.45
66	600213	亚星客车	456,000	4,929,360.00	0.44
67	002534	杭锅股份	519,600	4,915,416.00	0.44
68	300375	鹏翎股份	248,200	4,906,914.00	0.44
69	002588	史丹利	634,800	4,881,612.00	0.44
70	601998	中信银行	772,400	4,858,396.00	0.44
71	600641	万业企业	434,600	4,850,136.00	0.44
72	002014	永新股份	384,200	4,844,762.00	0.44
73	300039	上海凯宝	665,600	4,838,912.00	0.44
74	000890	法尔胜	591,900	4,818,066.00	0.43
75	600517	置信电气	621,300	4,703,241.00	0.42
76	300182	捷成股份	484,610	4,632,871.60	0.42
77	000718	苏宁环球	787,200	4,612,992.00	0.42
78	300320	海达股份	305,800	4,611,464.00	0.42
79	002195	二三四五	624,440	4,464,746.00	0.40
80	600557	康缘药业	256,500	4,260,465.00	0.38
81	300237	美晨科技	245,300	4,233,878.00	0.38
82	000673	当代东方	299,800	4,056,294.00	0.37
83	600053	九鼎投资	113,600	3,971,456.00	0.36
84	601567	三星医疗	379,100	3,950,222.00	0.36
85	000008	神州高铁	542,030	3,945,978.40	0.36
86	300092	科新机电	308,055	3,912,298.50	0.35
87	002088	鲁阳节能	286,650	3,431,200.50	0.31

88	002621	三垒股份	225,039	3,418,342.41	0.31
89	600568	中珠医疗	173,800	3,330,008.00	0.30
90	601137	博威合金	285,782	3,246,483.52	0.29
91	300395	菲利华	221,300	3,242,045.00	0.29
92	600657	信达地产	560,100	3,226,176.00	0.29
93	601999	出版传媒	350,400	3,195,648.00	0.29
94	300390	天华超净	331,700	3,041,689.00	0.27
95	300233	金城医药	143,700	3,016,263.00	0.27
96	000506	中润资源	344,500	3,014,375.00	0.27
97	300163	先锋新材	384,500	2,922,200.00	0.26
98	002693	双成药业	331,800	2,213,106.00	0.20
99	603023	威帝股份	168,600	2,124,360.00	0.19
100	002796	世嘉科技	63,600	2,003,400.00	0.18
101	000899	赣能股份	235,800	1,992,510.00	0.18
102	002469	三维工程	244,100	1,967,446.00	0.18
103	002598	山东章鼓	168,800	1,932,760.00	0.17
104	600493	凤竹纺织	174,500	1,905,540.00	0.17
105	002750	龙津药业	154,000	1,901,900.00	0.17
106	002484	江海股份	191,500	1,899,680.00	0.17
107	603015	弘讯科技	182,600	1,899,040.00	0.17
108	002708	光洋股份	206,200	1,894,978.00	0.17
109	600605	汇通能源	112,300	1,888,886.00	0.17
110	600156	华升股份	250,500	1,888,770.00	0.17
111	600883	博闻科技	159,452	1,860,804.84	0.17
112	600505	西昌电力	222,200	1,859,814.00	0.17
113	601038	一拖股份	201,100	1,856,153.00	0.17
114	600078	澄星股份	301,510	1,854,286.50	0.17
115	600203	福日电子	220,300	1,848,317.00	0.17
116	600515	海航基础	179,400	1,842,438.00	0.17
117	300455	康拓红外	151,240	1,836,053.60	0.17
118	600101	明星电力	186,000	1,832,100.00	0.17
119	600866	星湖科技	353,500	1,831,130.00	0.16
120	002225	濮耐股份	335,700	1,829,565.00	0.16
121	600616	金枫酒业	171,000	1,827,990.00	0.16
122	600981	汇鸿集团	246,400	1,825,824.00	0.16
123	603012	创力集团	220,800	1,823,808.00	0.16
124	002381	双箭股份	208,600	1,823,164.00	0.16
125	600336	澳柯玛	313,600	1,822,016.00	0.16
126	000779	三毛派神	130,200	1,821,498.00	0.16
127	603123	翠微股份	204,800	1,818,624.00	0.16
128	601188	龙江交通	377,100	1,817,622.00	0.16
129	002587	奥拓电子	241,050	1,817,517.00	0.16

130	000421	南京公用	248,800	1,816,240.00	0.16
131	600613	神奇制药	167,200	1,814,120.00	0.16
132	000713	丰乐种业	221,300	1,812,447.00	0.16
133	300193	佳士科技	217,600	1,808,256.00	0.16
134	600513	联环药业	177,100	1,808,191.00	0.16
135	002017	东信和平	162,430	1,807,845.90	0.16
136	300286	安科瑞	87,500	1,805,125.00	0.16
137	600784	鲁银投资	270,398	1,803,554.66	0.16
138	600127	金健米业	319,700	1,803,108.00	0.16
139	601368	绿城水务	183,200	1,802,688.00	0.16
140	600396	金山股份	463,100	1,801,459.00	0.16
141	603002	宏昌电子	339,500	1,799,350.00	0.16
142	300243	瑞丰高材	162,900	1,796,787.00	0.16
143	300318	博晖创新	253,700	1,796,196.00	0.16
144	002397	梦洁股份	268,800	1,795,584.00	0.16
145	600774	汉商集团	106,900	1,794,851.00	0.16
146	002119	康强电子	104,400	1,793,592.00	0.16
147	600310	桂东电力	261,400	1,793,204.00	0.16
148	600561	江西长运	193,200	1,792,896.00	0.16
149	300239	东宝生物	271,200	1,789,920.00	0.16
150	000536	华映科技	307,700	1,787,737.00	0.16
151	002731	萃华珠宝	83,900	1,787,070.00	0.16
152	600232	金鹰股份	220,500	1,783,845.00	0.16
153	002632	道明光学	225,200	1,783,584.00	0.16
154	600778	友好集团	230,700	1,783,311.00	0.16
155	002374	丽鹏股份	303,100	1,782,228.00	0.16
156	300445	康斯特	80,426	1,781,435.90	0.16
157	300218	安利股份	154,600	1,780,992.00	0.16
158	300181	佐力药业	256,600	1,780,804.00	0.16
159	002700	新疆浩源	165,400	1,773,088.00	0.16
160	603598	引力传媒	109,055	1,767,781.55	0.16
161	002096	南岭民爆	169,300	1,767,492.00	0.16
162	300211	亿通科技	196,300	1,766,700.00	0.16
163	002337	赛象科技	302,500	1,766,600.00	0.16
164	603789	星光农机	93,900	1,766,259.00	0.16
165	300452	山河药辅	64,204	1,765,610.00	0.16
166	300270	中威电子	150,600	1,763,526.00	0.16
167	002758	华通医药	125,400	1,760,616.00	0.16
168	300460	惠伦晶体	101,400	1,759,290.00	0.16
169	603309	维力医疗	98,500	1,752,315.00	0.16
170	600857	宁波中百	143,727	1,749,157.59	0.16
171	002144	宏达高科	102,595	1,744,115.00	0.16

172	300330	华虹计通	134,800	1,742,964.00	0.16
173	300220	金运激光	93,600	1,741,896.00	0.16
174	600724	宁波富达	367,100	1,740,054.00	0.16
175	300391	康跃科技	110,500	1,739,270.00	0.16
176	002645	华宏科技	97,100	1,730,322.00	0.16
177	300385	雪浪环境	60,600	1,724,676.00	0.16
178	300403	地尔汉宇	94,100	1,710,738.00	0.15
179	300434	金石东方	69,500	1,709,005.00	0.15
180	300468	四方精创	38,203	1,703,471.77	0.15
181	002791	坚朗五金	73,200	1,700,436.00	0.15
182	002034	美欣达	39,800	1,696,674.00	0.15
183	300488	恒锋工具	50,551	1,688,403.40	0.15
184	002729	好利来	24,307	1,678,155.28	0.15
185	000050	深天马 A	75,500	1,553,035.00	0.14
186	000951	中国重汽	101,000	1,544,290.00	0.14
187	002626	金达威	107,300	1,529,025.00	0.14
188	000581	威孚高科	58,800	1,522,920.00	0.14
189	600801	华新水泥	158,600	1,511,458.00	0.14
190	601225	陕西煤业	210,300	1,486,821.00	0.13
191	600409	三友化工	147,100	1,481,297.00	0.13
192	002080	中材科技	74,600	1,478,572.00	0.13
193	000688	建新矿业	184,800	1,478,400.00	0.13
194	000525	红太阳	78,800	1,466,468.00	0.13
195	600966	博汇纸业	282,200	1,464,618.00	0.13
196	000983	西山煤电	166,600	1,461,082.00	0.13
197	300328	宜安科技	131,300	1,457,430.00	0.13
198	000823	超声电子	100,900	1,454,978.00	0.13
199	600362	江西铜业	85,900	1,448,274.00	0.13
200	600971	恒源煤电	177,800	1,445,514.00	0.13
201	000725	京东方 A	347,300	1,444,768.00	0.13
202	002461	珠江啤酒	117,800	1,438,338.00	0.13
203	002472	双环传动	131,000	1,437,070.00	0.13
204	300061	康耐特	77,600	1,429,392.00	0.13
205	601898	中煤能源	242,800	1,427,664.00	0.13
206	600188	兖州煤业	116,476	1,425,666.24	0.13
207	000886	海南高速	287,000	1,423,520.00	0.13
208	600721	百花村	100,000	1,422,000.00	0.13
209	000521	美菱电器	222,100	1,421,440.00	0.13
210	300219	鸿利智汇	107,000	1,418,820.00	0.13
211	600219	南山铝业	418,100	1,417,359.00	0.13
212	601666	平煤股份	268,800	1,416,576.00	0.13
213	601699	潞安环能	181,100	1,416,202.00	0.13

214	600997	开滦股份	232,000	1,415,200.00	0.13
215	300083	劲胜精密	152,900	1,412,796.00	0.13
216	601006	大秦铁路	167,900	1,408,681.00	0.13
217	002705	新宝股份	93,700	1,408,311.00	0.13
218	002258	利尔化学	111,300	1,406,832.00	0.13
219	600348	阳泉煤业	206,800	1,402,104.00	0.13
220	600711	盛屯矿业	211,000	1,401,040.00	0.13
221	601677	明泰铝业	102,600	1,399,464.00	0.13
222	002335	科华恒盛	39,400	1,396,336.00	0.13
223	600057	象屿股份	137,200	1,395,324.00	0.13
224	000552	靖远煤电	390,400	1,393,728.00	0.13
225	002341	新纶科技	74,700	1,393,155.00	0.13
226	600546	山煤国际	290,100	1,389,579.00	0.13
227	600676	交运股份	186,300	1,387,935.00	0.13
228	600792	云煤能源	300,400	1,384,844.00	0.12
229	600331	宏达股份	253,200	1,382,472.00	0.12
230	600508	上海能源	118,400	1,381,728.00	0.12
231	002320	海峡股份	97,300	1,379,714.00	0.12
232	600141	兴发集团	111,400	1,378,018.00	0.12
233	600218	全柴动力	153,200	1,377,268.00	0.12
234	000937	冀中能源	225,000	1,377,000.00	0.12
235	600819	耀皮玻璃	204,600	1,376,958.00	0.12
236	600960	渤海活塞	180,099	1,374,155.37	0.12
237	002454	松芝股份	108,955	1,372,833.00	0.12
238	300230	永利股份	82,900	1,371,166.00	0.12
239	600269	赣粤高速	263,000	1,370,230.00	0.12
240	601100	恒立液压	84,100	1,369,989.00	0.12
241	002593	日上集团	260,000	1,367,600.00	0.12
242	603518	维格娜丝	55,900	1,367,314.00	0.12
243	002637	赞宇科技	127,700	1,366,390.00	0.12
244	300158	振东制药	84,227	1,366,161.94	0.12
245	002160	常铝股份	191,600	1,364,192.00	0.12
246	603611	诺力股份	51,700	1,362,295.00	0.12
247	002403	爱仕达	103,300	1,361,494.00	0.12
248	002537	海立美达	111,700	1,360,506.00	0.12
249	000949	新乡化纤	293,800	1,357,356.00	0.12
250	600390	五矿资本	112,000	1,356,320.00	0.12
251	300432	富临精工	56,700	1,355,130.00	0.12
252	603599	广信股份	89,400	1,352,622.00	0.12
253	603869	北部湾旅	49,600	1,349,616.00	0.12
254	600589	广东榕泰	184,100	1,345,771.00	0.12
255	300046	台基股份	71,900	1,344,530.00	0.12

256	300269	联建光电	67,000	1,342,010.00	0.12
257	002093	国脉科技	152,500	1,342,000.00	0.12
258	300306	远方光电	77,400	1,341,342.00	0.12
259	300179	四方达	204,900	1,340,046.00	0.12
260	300154	瑞凌股份	157,900	1,338,992.00	0.12
261	300410	正业科技	37,000	1,335,700.00	0.12
262	601579	会稽山	109,700	1,333,952.00	0.12
263	300349	金卡智能	47,400	1,323,408.00	0.12
264	002247	帝龙文化	100,600	1,319,872.00	0.12
265	300054	鼎龙股份	128,900	1,310,913.00	0.12
266	300139	晓程科技	124,600	1,307,054.00	0.12
267	002582	好想你	108,500	1,304,170.00	0.12
268	002759	天际股份	50,900	1,301,513.00	0.12
269	002599	盛通股份	88,300	1,297,127.00	0.12
270	002682	龙洲股份	94,100	1,256,235.00	0.11
271	300478	杭州高新	16,400	911,840.00	0.08
272	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
273	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
274	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
275	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
276	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
277	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
278	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
279	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
280	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
281	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
282	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
283	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
284	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
285	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
286	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	-	-	-	-

10.8 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	南方基金关于旗下部分基金增加中信银行为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-6
2	南方基金关于旗下部分基金增加金斧子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	2017-1-6
3	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构及开通相	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-11

	关业务的公告		
4	南方基金关于旗下部分基金增加富滇银行、南海农商银行、晋商银行、和谐销售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	2017-1-11
5	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	2017-1-17
6	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行、南京银行和广州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	2017-2-6
7	南方基金关于旗下部分基金增加植信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	2017-2-15
8	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	2017-2-23
9	南方基金关于旗下部分基金增加中原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	2017-2-23
10	南方基金关于旗下部分基金增加萧山农商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	2017-3-6
11	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富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	2017-3-15
12	南方基金关于旗下部分基金增加成都农商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	2017-3-27
13	南方基金关于旗下部分基金增加方正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	2017-3-29
14	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	2017-4-5
15	南方基金关于旗下部分基金增加大河财富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	2017-4-6
16	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	2017-4-23
17	南方基金关于旗下部分基金增加	中国证券报、上海	2017-4-27

	江西银行为代销机构及开通相关业务公告	证券报、证券时报	
18	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	2017-5-24
19	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-6-12

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方量化成长股票型证券投资基金的文件。
- 2、南方量化成长股票型证券投资基金基金合同。
- 3、南方量化成长股票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。

11.2 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。

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>