

南方高增长混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 29 日

重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方高增长混合(LOF)
场内简称	南方高增
基金主代码	160106
前端交易代码	160106
后端交易代码	160107
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年7月13日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
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	1,303,783,697.97份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005年9月21日

注:1. 后端收费模式申购基金份额不能转入交易所场内交易。

2. 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“南方高增”。

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, 以具有高成长性的公司为主要投资对象, 力争为投资者寻求最高的超额回报。
投资策略	作为以高增长为目标的混合型基金, 本基金在股票和可转债的投资中, 采用“自下而上”的策略进行投资决策, 以寻求超额收益。本基金选股主要依据南方基金公司建立的“南方高成长评价体系”, 通过定量与定性相结合的评价方法, 选择未来2年预期主营业务收入增长率和息税前利润增长率均超过GDP增长率3倍, 且根据该体系, 在全部上市公司中成长性和投资价值排名前5%的公司, 或者是面临重大的发展机遇, 具备超常规增长潜力的公司为主要投资对象, 这类股票占全部股票市值的比例不低于80%。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准采用上证综指, 债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数。作为混合型基金, 本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式: 基金整体业绩基准=上证综指×90%+上证国债指数×10%
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		南方基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日-2017年12月31日）	报告期（2016年1月1日-2016年12月31日）	报告期（2015年1月1日-2015年12月31日）
本期已实现收益	113,662,178.57	-227,366,251.32	1,378,410,891.74
本期利润	120,954,354.67	-277,117,204.16	1,110,568,644.11
加权平均基金份额本期利润	0.0869	-0.1910	0.8289
本期基金份额净值增长率	6.77%	-11.98%	36.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年12月31日)	报告期(2016年12月31日)	报告期(2015年12月31日)
期末可供分配基金份额利润	0.3516	0.2865	1.2325
期末基金资产净值	1,762,211,468.16	1,868,941,161.86	2,388,166,384.56

期末基金份额净值	1.3516	1.2865	2.2325
----------	--------	--------	--------

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。

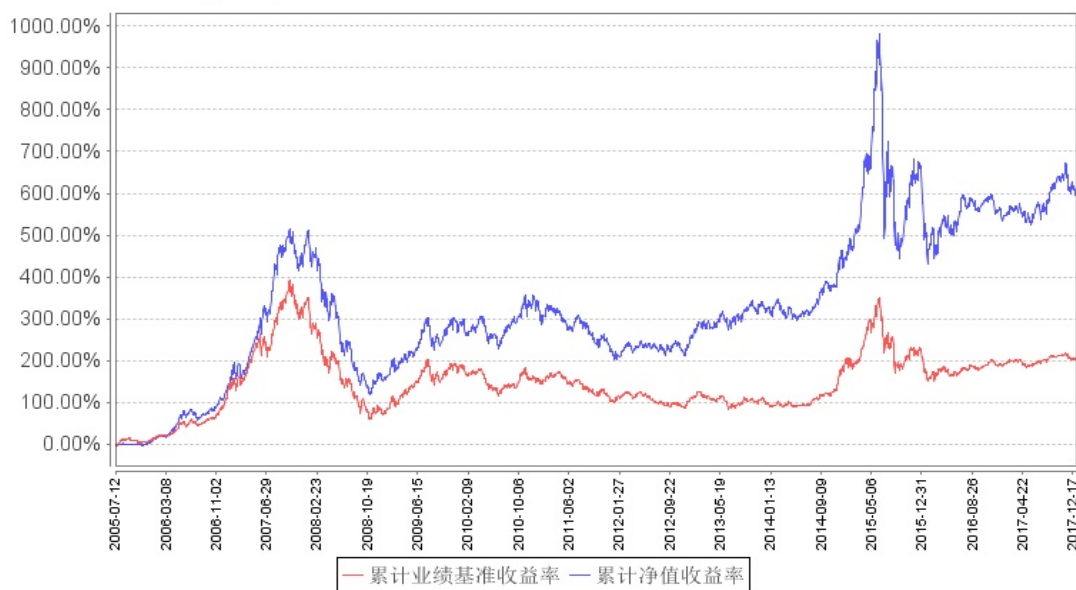
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-4.06%	1.08%	-1.11%	0.52%	-2.95%	0.56%
过去六个月	5.03%	1.02%	3.27%	0.49%	1.76%	0.53%
过去一年	6.77%	0.91%	5.99%	0.49%	0.78%	0.42%
过去三年	28.42%	2.00%	4.01%	1.50%	24.41%	0.50%
过去五年	95.59%	1.71%	44.51%	1.33%	51.08%	0.38%
自基金合同 生效起至今	604.03%	1.65%	205.27%	1.50%	398.76%	0.15%

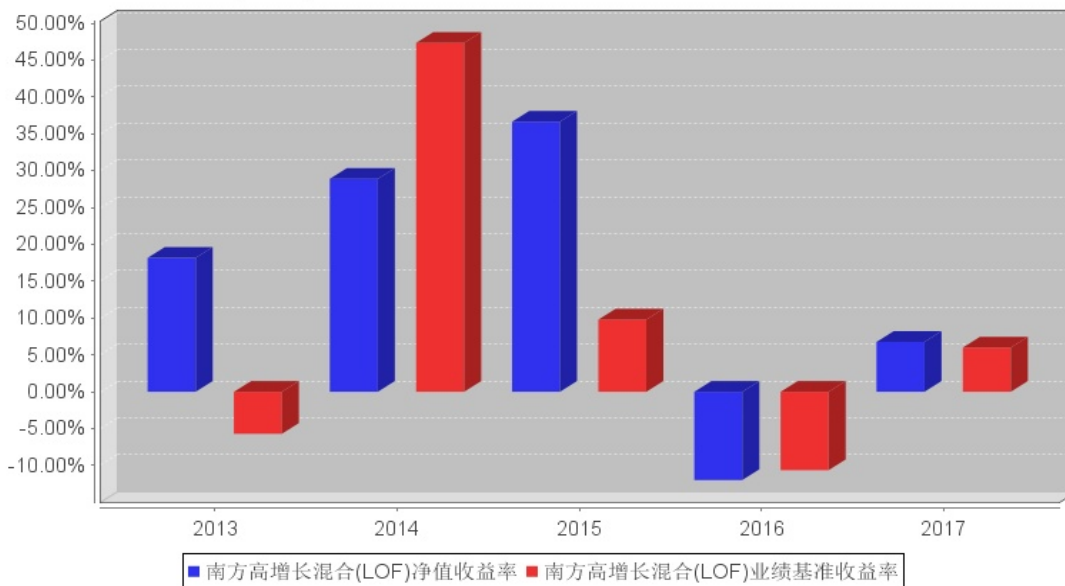
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方高增长混合(LOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方高增长混合(LOF)基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	0.2	8,722,163.41	20,277,398.45	28,999,561.86	注：本期分红

					一次
2016	6.45	256,959,815.76	434,409,886.96	691,369,702.72	注：本期分红一次
2015	1.8	108,316,823.11	186,179,026.21	294,495,849.32	注：本期分红一次
合计	8.45	373,998,802.28	640,866,311.62	1,014,865,113.90	

§ 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。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：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%及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，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超7,200亿元，旗下管理153只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、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		
张原	本基金基金经理	2011年2月17日	-	11	美国密歇根大学经济学硕士学位，具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金，曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员，南方高增及南方隆元基金经理助理；现任权益投资部总经理、境内权益投资决策委员会委员；2009年9月至2013年4月，任南方500基金经理；2010年2月至2016年10月，

					任南方绩优基金经理；2011年2月至今，任南方高增基金经理；2015年12月至今，任南方成份基金经理；2017年1月至今，任南方教育股票基金经理；2017年11月至今，任南方互联混合基金经理。
邹寅隆	本基金基金助理	2017年5月15日	-	3	清华大学计算机科学与技术专业硕士，具有基金从业资格。2014年7月加入南方基金，历任助理研究员、研究员，负责计算机行业研究。2017年5月至今，任南方成份、南方高增、南方教育股票基金经理助理。

注:1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”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《南方高增长混合型证券投资基金合同》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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，

完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5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，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年A股市场震荡上行，呈现二八分化的结构性行情，市场追捧业绩增长有确定性和可持续性的企业，绩优白马股获得估值溢价、超额收益明显。全年来看，上证综指上涨6.56%，大盘蓝筹股为代表的上证50和沪深300分别上涨25.08%、21.78%，中小板指上涨16.73%，而创业板指下跌10.67%。

年初本组合管理组对2017年宏观经济和市场的基本判断是：市场以震荡为主，市场对企业业绩增长的确定性和可持续性很看重，绩优白马股是投资主线。监管层对2017年定调去杠杆防风险、加强金融领域的监管，叠加美联储继续加息，预计国内货币政策稳健中性，流动性难有边际放松的空间。对标国际市场的龙头公司，国内很多行业龙头有估值优势、业绩增长确定性较高，具有较好的配置价值，如银行、家电等。同时，中国经济转型升级需要新兴行业拉动，通信、电子等行业是重要的新兴方向，其中5G和消费电子的行业趋势和投资机会最确定，值得重点配置。预计市场风格趋向均衡，中小板、创业板为代表的新兴成长与上证50、沪深300为代表蓝筹价值的市场表现将呈现收拢态势。无论新兴成长股还是蓝筹价值股，都是以业绩为王，绩优的行业龙头是投资首选。市场下行的风险主要是监管层对金融去杠杆的执行力度和国内通胀预期的变化。回顾2017年的宏观经济走势和A股市场表现，基本验证了本基金管理组年初的判断，企业盈利回升超预期，资金面稳健中性，利率不断攀升维持高位，A股市场绩优的白马龙头表现优异。本基金在2017年的投资有得有失，继续坚持研究为本、积极挖掘高增长潜力的公司，保持精选个股的成长型投资风格。本基金结合对宏观和产业链的预判，在5G、电子、金融等行业的投资上取得了较理想的结果。

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1.3516元,本报告期份额净值增长率为6.77%,同期业绩比较基准增长率为5.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从近期各项经济数据来看,总体宏观经济处于平稳状态,企业盈利向好。2017年中国GDP增速6.9%,是2010年以来经济增速首次回升。分季度来看,2017年的四个季度分别是6.9%、6.9%、6.8%、6.8%,下半年经济增速出现小幅回落。全年经济数据体现出中国经济增长的韧性较强。12月PMI为51.6,比上月回落0.2个百分点,持续位于景气区间,PMI数据连续17个月保持在荣枯线之上。12月PPI同比上涨4.9%,CPI同比上涨1.8%,连续11个月低于2%,处于可控的范围内。国际经济逐步复苏,发达国家和新兴市场经济数据向好,欧盟连续两月创数据发布以来新高,日本连续两月新高,美国PMI达到59.7的高位,印度创下2012年12月以来新高。房地产销售继续触底反弹,尤其一二线城市,部分二线城市限购政策有放松迹象。展望2018年,宏观经济仍具备较强韧性。目前国内房地产库存水平处于低位,三架马车中投资向下有底,海外经济复苏强劲,出口贸易也随之显著回暖,同时居民消费意愿较强。政策方面,预计央行将保持货币政策稳健中性,监管层坚持去杠杆。金融去杠杆在2017年初见成效,市场出现系统性风险的概率已显著下降,市场利率中枢大幅上行的空间相对有限,这将有助于风险偏好的整体修复,预计市场风格将进一步趋向均衡。

A股在2018年将首次纳入MSCI指数,预计低估值蓝筹和绩优白马仍将获得持续的资金流入。同时,部分估值合理、业绩优异的优质成长股具备较好的投资价值,代表着中国经济转型升级的未来。我们维持对市场谨慎乐观的判断,继续保持中性偏高的股票仓位,看好通信、传媒等新兴行业质地优秀的成长股、对标国际市场有估值优势的金融股、景气向上的周期股。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况,坚持从保护基金持有人利益出发,树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念,继续致力于合规与内控机制的完善,积极推动主动合规风控管理,持续加强业务风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。

本报告期内,本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况,积极推动监管新规落实,持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程,并积极开展形式丰富的合规培训与考试,加强员工行为规范检查、加大合规问责力度,强化全员合规、主动合规理念;对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期稽核、专项稽核及多项自查,

检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；积极参与新产品、新业务合规评估工作，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；继续按照风险为本的原则积极开展各项反洗钱工作，进一步升级反洗钱业务系统，优化其他反洗钱资源配置，重点推进《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》的具体落实工作，加强业务部门反洗钱风险评估频率，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：基金收益分配采用现金方式，投资人可选择获取现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；每一基金份额享有同等分配权；基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；如果基金当期出现亏损，则不进行

收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多四次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的50%。成立不满三个月，收益可不分配。法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本基金于2018年1月16日进行本基金的2017年年度收益分配（每10份基金份额派发红利0.44元）。

本报告期内2017年1月18日已分配数（每10份基金份额派发红利0.2元）为以往年度收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南方高增长混合型证券投资基金（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 审计报告

本基金2017年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第22801号“标准无保留意见的审计报告”，投资者

可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方高增长混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：		
银行存款	68,712,076.79	138,822,552.31
结算备付金	18,432,086.39	4,228,574.65
存出保证金	732,172.94	829,502.45
交易性金融资产	1,566,919,502.89	1,735,135,124.67
其中：股票投资	1,465,246,002.89	1,644,598,619.67
基金投资	-	-
债券投资	101,673,500.00	90,536,505.00
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	150,000,345.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,723,236.08	1,200,648.52
应收股利	-	-
应收申购款	255,019.38	808,098.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,806,774,439.47	1,881,024,500.61
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31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	36,957,930.20	5,240,722.12
应付赎回款	1,603,090.96	960,045.90
应付管理人报酬	2,273,610.73	2,398,494.24
应付托管费	378,935.11	399,749.04
应付销售服务费	-	-

应付交易费用	2,952,317.49	2,790,347.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	397,086.82	293,980.35
负债合计	44,562,971.31	12,083,338.75
所有者权益:		
实收基金	1,303,783,697.97	1,452,706,484.67
未分配利润	458,427,770.19	416,234,677.19
所有者权益合计	1,762,211,468.16	1,868,941,161.86
负债和所有者权益总计	1,806,774,439.47	1,881,024,500.61

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.3516 元, 基金份额总额 1,303,783,697.97 份。

7.2 利润表

会计主体: 南方高增长混合型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	169,126,816.64	-220,060,062.94
1. 利息收入	7,267,696.64	2,836,780.48
其中: 存款利息收入	708,187.05	2,361,350.11
债券利息收入	3,433,917.55	123,148.55
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,125,592.04	352,281.82
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	154,435,568.55	-173,305,507.06
其中: 股票投资收益	141,610,363.10	-184,019,922.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	114,930.81	79,300.00
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	12,710,274.64	10,635,115.87

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7,292,176.10	-49,750,952.84
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	131,375.35	159,616.48
减：二、费用	48,172,461.97	57,057,141.22
1. 管理人报酬	27,264,421.57	27,895,666.74
2. 托管费	4,544,070.23	4,649,277.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	15,848,767.24	24,000,709.26
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	515,202.93	511,487.41
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	120,954,354.67	-277,117,204.16
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	120,954,354.67	-277,117,204.16

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：南方高增长混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,452,706,484.67	416,234,677.19	1,868,941,161.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	120,954,354.67	120,954,354.67
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)	-148,922,786.70	-49,761,699.81	-198,684,486.51
其中：1. 基金申购	87,340,804.68	25,239,486.55	112,580,291.23

款			
2. 基金赎回款	-236,263,591.38	-75,001,186.36	-311,264,777.74
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)	-	-28,999,561.86	-28,999,561.86
五、期末所有者权益(基金净值)	1,303,783,697.97	458,427,770.19	1,762,211,468.16
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,069,733,193.22	1,318,433,191.34	2,388,166,384.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-277,117,204.16	-277,117,204.16
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)	382,973,291.45	66,288,392.73	449,261,684.18
其中：1. 基金申购款	541,918,452.09	117,487,441.66	659,405,893.75
2. 基金赎回款	-158,945,160.64	-51,199,048.93	-210,144,209.57
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)	-	-691,369,702.72	-691,369,702.72
五、期末所有者权益(基金净值)	1,452,706,484.67	416,234,677.19	1,868,941,161.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年12月25日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 税项

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

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、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
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于2018年1月4日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	0.00	0.00	46,067,327.08	0.29
兴业证券	0.00	0.00	680,959,219.55	4.29

7.4.4.1.2 权证交易

注:无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	41,980.46	0.29	41,980.46	1.50
兴业证券	620,559.67	4.27	-	-

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

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

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	27,264,421.57
其中:支付销售机构的客户维护费	3,717,954.31	3,744,302.93

注:支付基金管理人南方基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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:日管理人报酬=前一日基金资产净值

X 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	4,544,070.23

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

注:无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	68,712,076.79	505,835.15	138,822,552.31	2,220,935.13

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 利润分配情况

单位:人民币元

序号	权益 登记日	场内除 息日	场外 除息 日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2017年 01月18日	2017年 01月 19日	2017年 01月 18日	0.2000	8,722,163.41	20,277,398.45	28,999,561.86	
合计	-	-	-	0.2000	8,722,163.41	20,277,398.45	28,999,561.86	

7.4.6 期末本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
7.4.12.1.2 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(单位张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123004	铁汉转债	2017-12-18	2018-01-26	新债未上市	100.00	100.00	21,715	2,171,500.00	2,171,500.00	-

7.4.6.2 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
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	

注：：本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,465,246,002.89	81.10
	其中：股票	1,465,246,002.89	81.10
2	固定收益投资	101,673,500.00	5.63
	其中：债券	101,673,500.00	5.63
	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	150,000,345.00	8.30
	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	87,144,163.18	4.82
7	其他各项资产	2,710,428.40	0.15
8	合计	1,806,774,439.47	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	35,278,000.00	2.00
C	制造业	1,213,188,106.18	68.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	73,146,923.40	4.15
F	批发和零售业	36,624,000.00	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	35,082,019.05	1.99

	务业		
J	金融业	52,486,889.46	2.98
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	19,440,064.80	1.10
	合计	1,465,246,002.89	83.15

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	4,000,083	145,443,017.88	8.25
2	002341	新纶科技	3,600,094	99,002,585.00	5.62
3	000821	京山轻机	6,000,000	74,760,000.00	4.24
4	300072	三聚环保	2,100,044	73,774,545.72	4.19
5	300115	长盈精密	3,600,006	72,252,120.42	4.10
6	002019	亿帆医药	3,000,000	66,750,000.00	3.79
7	000823	超声电子	4,000,040	54,200,542.00	3.08
8	601318	中国平安	750,027	52,486,889.46	2.98
9	002384	东山精密	1,800,068	51,229,935.28	2.91
10	300145	中金环境	4,200,000	50,190,000.00	2.85

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> 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	183,960,418.48	9.84
2	300115	长盈精密	182,333,106.55	9.76

3	300323	华灿光电	158,364,565.00	8.47
4	000823	超声电子	116,323,205.70	6.22
5	600036	招商银行	111,003,004.43	5.94
6	600409	三友化工	106,318,871.39	5.69
7	601318	中国平安	101,653,004.40	5.44
8	002384	东山精密	94,353,114.39	5.05
9	000070	特发信息	91,535,122.61	4.90
10	600563	法拉电子	87,924,559.19	4.70
11	000821	京山轻机	86,325,699.47	4.62
12	002491	通鼎互联	84,106,023.59	4.50
13	002019	亿帆医药	83,824,264.25	4.49
14	600266	北京城建	81,156,820.51	4.34
15	000401	冀东水泥	80,537,845.63	4.31
16	300308	中际旭创	80,138,745.22	4.29
17	300072	三聚环保	79,064,346.57	4.23
18	300197	铁汉生态	77,564,847.17	4.15
19	002341	新纶科技	77,048,723.04	4.12
20	603355	莱克电气	73,470,115.92	3.93
21	600388	龙净环保	73,238,144.27	3.92
22	002138	顺络电子	68,286,798.65	3.65
23	300078	思创医惠	67,471,030.93	3.61
24	600111	北方稀土	67,091,755.90	3.59
25	600549	厦门钨业	65,712,217.26	3.52
26	002174	游族网络	64,549,267.37	3.45
27	002222	福晶科技	63,310,756.84	3.39
28	000571	新大洲A	60,480,743.85	3.24
29	002690	美亚光电	57,988,567.37	3.10
30	300418	昆仑万维	53,964,499.84	2.89
31	600362	江西铜业	53,908,466.95	2.88
32	600745	闻泰科技	53,486,324.56	2.86
33	601166	兴业银行	50,428,412.96	2.70
34	002792	通宇通讯	49,099,231.89	2.63
35	002179	中航光电	48,238,731.27	2.58
36	300403	地尔汉宇	46,609,838.90	2.49
37	300373	扬杰科技	46,028,314.63	2.46
38	000050	深天马A	44,716,059.15	2.39
39	603228	景旺电子	44,494,878.33	2.38
40	000807	云铝股份	44,288,414.14	2.37
41	002479	富春环保	43,312,202.09	2.32
42	002511	中顺洁柔	42,994,007.26	2.30
43	000970	中科三环	41,940,374.16	2.24
44	002128	露天煤业	41,563,895.92	2.22

45	600499	科达洁能	41,144,140.25	2.20
46	000059	华锦股份	39,010,574.69	2.09
47	300477	合纵科技	38,615,288.80	2.07
48	002042	华孚时尚	37,724,592.62	2.02
49	002090	金智科技	37,674,422.53	2.02

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600266	北京城建	229,428,435.16	12.28
2	000063	中兴通讯	202,026,910.75	10.81
3	300323	华灿光电	145,587,892.87	7.79
4	600036	招商银行	131,700,136.47	7.05
5	000070	特发信息	117,988,224.29	6.31
6	601166	兴业银行	110,301,991.28	5.90
7	600547	山东黄金	108,469,266.98	5.80
8	000059	华锦股份	89,156,179.39	4.77
9	601318	中国平安	85,571,741.27	4.58
10	600682	南京新百	84,250,681.76	4.51
11	600409	三友化工	84,004,590.82	4.49
12	300408	三环集团	83,673,937.02	4.48
13	000401	冀东水泥	80,584,389.12	4.31
14	600111	北方稀土	74,746,357.97	4.00
15	300078	思创医惠	73,968,983.93	3.96
16	002138	顺络电子	71,546,052.16	3.83
17	600388	龙净环保	69,190,571.58	3.70
18	300202	聚龙股份	68,721,331.88	3.68
19	300115	长盈精密	65,138,962.69	3.49
20	600797	浙大网新	61,503,360.59	3.29
21	002384	东山精密	61,449,732.62	3.29
22	000998	隆平高科	59,125,208.89	3.16
23	300373	扬杰科技	58,670,154.32	3.14
24	300418	昆仑万维	58,315,891.73	3.12
25	002792	通宇通讯	57,995,959.38	3.10
26	000662	天夏智慧	57,907,397.33	3.10
27	601801	皖新传媒	57,343,623.77	3.07
28	300308	中际旭创	56,353,955.25	3.02

29	000807	云铝股份	53,422,185.05	2.86
30	002690	美亚光电	53,124,172.65	2.84
31	600079	人福医药	52,534,232.21	2.81
32	000823	超声电子	51,559,234.66	2.76
33	600362	江西铜业	50,769,953.04	2.72
34	300033	同花顺	50,556,868.70	2.71
35	002117	东港股份	50,301,683.84	2.69
36	002142	宁波银行	49,998,524.86	2.68
37	603228	景旺电子	49,203,919.09	2.63
38	300161	华中数控	49,197,802.92	2.63
39	601939	建设银行	48,881,658.08	2.62
40	603355	莱克电气	47,245,526.16	2.53
41	600499	科达洁能	46,842,822.50	2.51
42	000050	深天马A	46,283,106.86	2.48
43	300477	合纵科技	43,994,919.47	2.35
44	002185	华天科技	42,562,929.57	2.28
45	603986	兆易创新	41,998,149.45	2.25
46	300403	地尔汉宇	41,803,950.49	2.24
47	002019	亿帆医药	41,164,726.29	2.20
48	600563	法拉电子	40,725,456.45	2.18
49	002222	福晶科技	40,184,027.81	2.15
50	000970	中科三环	40,063,087.39	2.14
51	000687	华讯方舟	39,402,417.93	2.11
52	600782	新钢股份	38,050,006.21	2.04
53	601009	南京银行	38,021,734.51	2.03
54	600803	新奥股份	38,009,604.23	2.03
55	002368	太极股份	37,950,228.02	2.03

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	5,065,672,697.84
卖出股票收入(成交)总额	5,394,357,008.82

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,502,000.00	5.65
	其中：政策性金融债	99,502,000.00	5.65
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)	2,171,500.00	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	101,673,500.00	5.77

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150418	15农发18	600,000	59,694,000.00	3.39
2	170207	17国开07	400,000	39,808,000.00	2.26
3	123004	铁汉转债	21,715	2,171,500.00	0.12

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	732,172.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,723,236.08
5	应收申购款	255,019.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,710,428.40

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

份额单位:份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例(%)	持有份额	占总份额比 例(%)
49,839	26,159.91	1,497,256.13	0.11	1,302,286,441.84	99.89

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	苗春波	3,188,918.00	5.33
2	张伟彬	1,371,000.00	2.29
3	曾立志	1,250,000.00	2.09
4	郭红斌	1,083,299.00	1.81
5	施建昌	793,279.00	1.32
6	张香芝	782,037.00	1.31
7	陈文荪	527,175.00	0.88
8	徐国英	498,763.00	0.83
9	孙涛	471,724.00	0.79
10	刘倩倩	390,959.00	0.65

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,711,319.29	0.1313

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年7月13日) 基金份额总额	1,276,869,477.13
本报告期期初基金份额总额	1,452,706,484.67
本报告期基金总申购份额	87,340,804.68
减：本报告期基金总赎回份额	236,263,591.38
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	1,303,783,697.97

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017年1月23日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

2017年12月8日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

2017年8月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用95000元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为12年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

		成交金额	占当期股票成交 总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
天风证券	1	4,640,279,933.08	44.39%	4,228,696.91	44.55%	-
长江证券	1	1,558,872,706.70	14.91%	1,420,559.66	14.97%	-
万和证券	1	1,231,759,499.34	11.78%	1,122,494.06	11.83%	-
英大证券	1	1,048,613,064.46	10.03%	955,600.34	10.07%	-
中银国际	1	305,446,215.64	2.92%	278,356.39	2.93%	-
东北证券	1	296,882,842.35	2.84%	270,548.31	2.85%	-
财富证券	1	255,111,631.69	2.44%	232,484.43	2.45%	-
民生证券	1	209,695,367.77	2.01%	191,092.08	2.01%	-
中信建投	2	200,179,235.03	1.91%	182,418.04	1.92%	-
广州证券	1	191,130,633.77	1.83%	174,175.62	1.84%	-
东吴证券	1	190,517,440.83	1.82%	173,619.54	1.83%	-
中信证券	2	169,035,988.44	1.62%	154,043.13	1.62%	-
广发证券	2	86,170,648.13	0.82%	78,523.98	0.83%	-
西部证券	1	69,998,861.88	0.67%	29,104.74	0.31%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东兴证券	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专用交易席位的选择标准和程序: A: 选择标准 (a)公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好; (b)公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告; (c)公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求; (d)建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。 B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位: (a)服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座; (b)研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确; (c)资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,089,474.96	15.61%	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	1,154,000,000.00	5.83%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

广发证 券	-	-	245,000,000.00	1.24%	-	-
广州证 券	-	-	1,730,000,000.00	8.73%	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华泰联 合	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	265,000,000.00	1.34%	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	197,873.00	2.84%	-	-	-	-
万和证 券	538,458.90	7.72%	7,825,000,000.00	39.50%	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	5,152,478.60	73.84%	4,519,000,000.00	22.81%	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中投证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	704,000,000.00	3.55%	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	3,369,000,000.00	17.01%	-	-
中原证 券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

注:无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。