

南方高增长混合型证券投资基金 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。

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。

§ 2 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	
交易代码	160106 (前端)	160107 (后端)
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	1,402,357,479.09 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

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	基金管理人的办公地址、基金托管人的住所

§ 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	24,029,723.56
本期利润	29,015,673.61
加权平均基金份额本期利润	0.0202
本期加权平均净值利润率	1.61%
本期基金份额净值增长率	1.66%
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	402,318,198.15
期末可供分配基金份额利润	0.2869
期末基金资产净值	1,804,675,677.24
期末基金份额净值	1.2869

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	570.33%

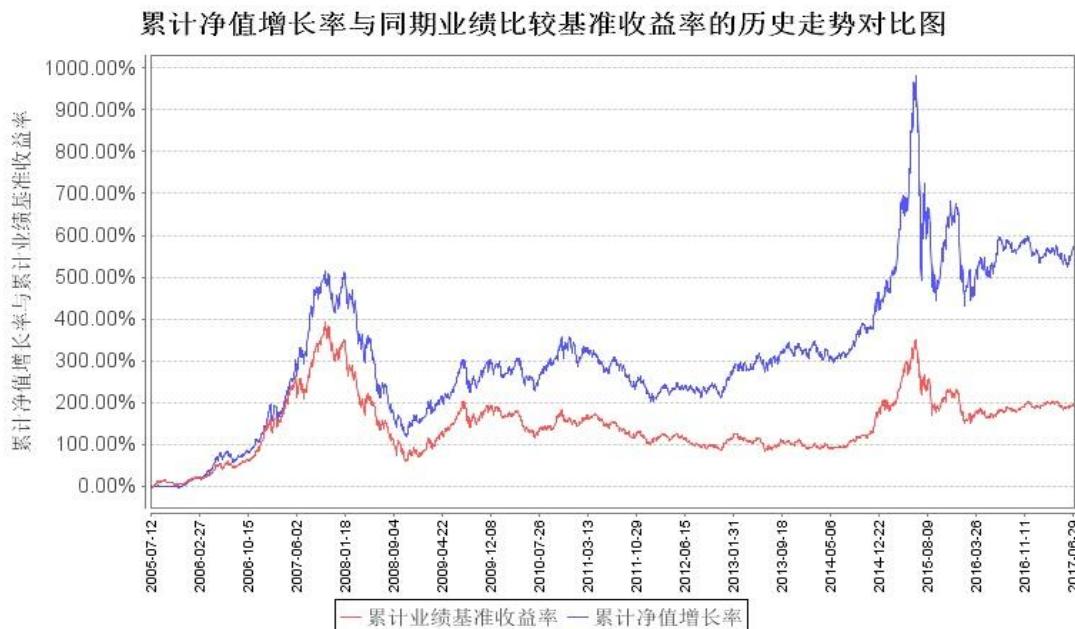
- 注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 期末可供分配利润 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。
3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.56	0.92	2.19	0.46	3.37	0.46
过去三个月	2.32	0.91	-0.82	0.52	3.14	0.39
过去六个月	1.66	0.78	2.63	0.49	-0.97	0.29
过去一年	2.39	0.76	8.27	0.58	-5.88	0.18
过去三年	60.17	2.01	52.46	1.56	7.71	0.45
自基金合同生效起至今	570.33	1.68	195.59	1.53	374.74	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



§ 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		
邹寅隆	本基金助理	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。
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；现任权益投资部副总监、境内权益投资决策委员会委员、FOF 投资决策委员会委员、社保理事会委托产品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。

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 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

今年上半年国内宏观经济保持平稳，GDP 增速 6.9%，超市场预期。分季度看，GDP 一季度同比增长 6.9%，二季度同比增长 6.9%。经济数据继续向好，PMI 数据连续一年保持在荣枯线之上，经济企稳迹象明显。上半年固定资产投资同比增长 8.6%，规模以上工业增加值同比增长 6.9%。上半年 PPI 同比增长 6.6%，远高于去年同期-3.9%。由于大宗商品价格上涨，生产资料 PPI 涨势显著。

上半年 CPI 涨势温和，同比上涨 1.4%，去年同期为 2.1%。CPI 除 1 月因季节性因素暂时高抬外，上半年月度 CPI 同比涨幅稳定在 0.8%-1.5% 区间内，物价涨幅温和。上半年鲜菜、猪肉和蛋类等食品价格下跌，其中鲜菜价格受暖冬影响超预期下滑，猪肉和蛋类价格因需求疲软而走低。自二季度起，食品项 CPI 同比跌幅逐渐收窄。上半年非食品项 CPI 涨势较为稳定。综合来看 CPI 处于可控状态。

美联储在 3 月和 6 月分别加息，对中国利率造成一定影响。央行在一季度已经两次提升了公开市场的逆回购、SLF、MLF 利率。二季度金融去杠杆对市场造成影响，无风险利率持续回升。6 月央行表态缓和，认为金融去杠杆取得初步成果，且 M2 增长回落到 10% 以下，政策态度进入重要观察时点。

报告期内，A 股指数在 1 月初调整后迎来一波上涨行情，后遭遇 4 月、5 月下跌调整，6 月指数开始反弹，上半年上证综指在 3000 点到 3300 点之间震荡。上证 50、沪深 300 等权重指数震荡上行创年内新高。上半年上证综指上涨 2.86%，上证 50 指数、沪深 300 指数分别上涨 11.50%、10.78%，中小板指数上涨 7.33%，创业板指数下跌 7.34%。上半年市场结构分化明显。2 月、3 月指数上涨以优质成长股和新能源产业链为代表，6 月上证 50、沪深 300 等指数引领市场反弹。南方高增长基金继续坚持以研究为本、积极挖掘有高增长潜力的公司、精选个股的成长型投资风格，重点布局了质地优秀的成长股、估值有安全边际的转型类个股、景气向上的周期股和银行股等。在资产配置上，本基金继续保持了中性偏高的股票仓位。

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 1.2869 元，本报告期份额净值增长率为 1.66%，同期业绩

比较基准增长率为 2.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观经济有望保持平稳，经济阶段性回升的惯性仍在，PPI 再度回升难度较大。地方债发行的增速由负转正，有助于后期基建投资增速的回升。三四线城市房地产去库存取得显著成果，三四线城市地产销售火爆、房价大幅上涨，支撑了全国地产销售 10%的增长，有助于扭转开发商过度悲观的预期、刺激地产投资。钢材等大宗品的社会库存已大幅下降，有助于缓解下半年的库存压力、增加潜在补库存空间。通胀方面，CPI 将温和回升，需要关注 PPI 对 CPI 的滞后传导效应，目前判断应该不会触及 3%的目标值。

今年上半年国内为金融去杠杆实施了较为严厉的货币政策，在金融去杠杆取得一定效果的背景下，叠加通胀形势可控的预期，货币政策过度偏紧的格局有望略微放松。我们预计三季度或许还有金融去杠杆导致的小波澜，但货币政策对金融市场和实体经济的最大冲击已经过去。A 股市场方面，上市公司的盈利正在复苏，但处于高位的无风险利率将压制估值水平，因此我们预计未来市场继续呈现震荡走势，个股的结构性机会仍然是投资的重要方向，同时需要加大对潜在国内外风险的关注度。

我们维持对下半年市场行情谨慎乐观的判断，在资产配置上本基金继续保持中性偏高的股票仓位，注重自下而上的个股研究。本基金保持长期以来挖掘高成长公司的投资风格，继续自下而上精选优质成长股，包括高成长的新兴行业公司、传统行业转型公司等。本基金继续重点布局估值调整到位的白马成长股，关注通信、电子等新兴行业，同时积极配置景气向上的周期股和金融股等。

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、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，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，本报告期本基金未有收益分配事项。

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。

4.8 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：南方高增长混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	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	6.4.4.1	6,900,814.92	138,822,552.31
结算备付金		21,540,499.67	4,228,574.65
存出保证金		803,556.42	829,502.45
交易性金融资产	6.4.4.2	1,756,970,381.38	1,735,135,124.67
其中：股票投资		1,666,889,381.38	1,644,598,619.67
基金投资		—	—
债券投资		90,081,000.00	90,536,505.00
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.4.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.4.4	20,000,000.00	—
应收证券清算款		4,558,799.28	—
应收利息	6.4.4.5	2,878,101.03	1,200,648.52
应收股利		—	—
应收申购款		62,015.84	808,098.01
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.4.6	—	—
资产总计		1,813,714,168.54	1,881,024,500.61
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	6.4.4.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		684,769.35	5,240,722.12
应付赎回款		1,484,542.93	960,045.90
应付管理人报酬		2,164,815.48	2,398,494.24
应付托管费		360,802.59	399,749.04
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.4.7	4,111,452.78	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	6.4.4.8	232,108.17	293,980.35
负债合计		9,038,491.30	12,083,338.75
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	1,402,357,479.09	1,452,706,484.67
未分配利润	6.4.4.10	402,318,198.15	416,234,677.19
所有者权益合计		1,804,675,677.24	1,868,941,161.86
负债和所有者权益总计		1,813,714,168.54	1,881,024,500.61

注: 报告截止日 2017 年 06 月 30 日, 基金份额净值 1.2869 元, 基金份额总额 1,402,357,479.09 份。

6.2 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 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		51,320,014.50	-261,150,763.53
1. 利息收入		3,393,523.37	1,295,986.59
其中: 存款利息收入	6.4.4.11	491,754.99	1,223,855.45
债券利息收入		1,709,919.35	72,131.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,191,849.03	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”号填列)		42,883,179.35	-292,286,834.77
其中: 股票投资收益	6.4.4.12	31,725,965.09	-299,219,176.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	175,527.17	79,300.00
资产支持证券投资收益	6.4.4.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	10,981,687.09	6,853,041.77
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.4.17	4,985,950.05	29,762,868.75
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	57,361.73	77,215.90
减：二、费用		22,304,340.89	30,821,422.64
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	13,412,941.92	13,281,437.75
2. 托管费	6.4.7.2.2	2,235,490.33	2,213,572.98
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	6,400,155.75	15,069,801.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.20	255,752.89	256,610.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		29,015,673.61	-291,972,186.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		29,015,673.61	-291,972,186.17

6.3 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 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）	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）	-	29,015,673.61	29,015,673.61
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)	-50,349,005.58	-13,932,590.79	-64,281,596.37
其中：1. 基金申购款	55,348,870.67	13,613,607.98	68,962,478.65
2. 基金赎回款	-105,697,876.25	-27,546,198.77	-133,244,075.02
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）	1,402,357,479.09	402,318,198.15	1,804,675,677.24
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）	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）	-	-291,972,186.17	-291,972,186.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	411,094,599.25	75,725,560.33	486,820,159.58
其中：1. 基金申购款	481,313,206.15	98,096,996.07	579,410,202.22
2. 基金赎回款	-70,218,606.90	-22,371,435.74	-92,590,042.64
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）	1,480,827,792.47	410,816,862.78	1,891,644,655.25

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 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。

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	6,900,814.92
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	6,900,814.92

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	1, 618, 661, 807. 37	1, 666, 889, 381. 38	48, 227, 574. 01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	90, 278, 310. 00	90, 081, 000. 00
	合计	90, 278, 310. 00	90, 081, 000. 00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1, 708, 940, 117. 37	1, 756, 970, 381. 38	48, 030, 264. 01

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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	20, 000, 000. 00	-
合计	20, 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	1, 723. 62
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	8, 725. 94
应收债券利息	2, 869, 257. 54
应收买入返售证券利息	-1, 931. 51
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	325. 44

合计	2,878,101.03
----	--------------

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	4,111,452.78
银行间市场应付交易费用	—
合计	4,111,452.78

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	4,001.11
预提费用	228,107.06
其他	—
应付指数使用费	—
应退替代款	—
可退替代款	—
合计	232,108.17

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	1,452,706,484.67	1,452,706,484.67
本期申购	55,348,870.67	55,348,870.67
本期赎回 (以“-”号填列)	-105,697,876.25	-105,697,876.25
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	1,402,357,479.09	1,402,357,479.09

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 截至 2017 年 06 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 65,298,846.00 份，(2016 年 12 月 31 日：66,507,513.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 1,337,058,633.09 份，(2016 年 12 月 31 日：1,386,198,971.67 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额

净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	1,101,642,398.81	-685,407,721.62	416,234,677.19
本期利润	24,029,723.56	4,985,950.05	-
本期基金份额交易产生的变动数	-37,026,877.88	23,094,287.09	-13,932,590.79
其中：基金申购款	40,895,125.59	-27,281,517.61	13,613,607.98
基金赎回款	-77,922,003.47	50,375,804.70	-27,546,198.77
本期已分配利润	-28,999,561.86	-	-28,999,561.86
本期末	1,059,645,682.63	-657,327,484.48	402,318,198.15

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	400,188.47
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	86,002.79
其他	5,563.73
合计	491,754.99

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	2,139,520,887.45
减：卖出股票成本总额	2,107,794,922.36
买卖股票差价收入	31,725,965.09

6.4.4.13 基金投资收益

注：无。

6.4.4.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,350,351.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,174,000.00
减：应收利息总额	824.43
买卖债券差价收入	175,527.17

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

注：无。

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	10,981,687.09
基金投资产生的股利收益	—
合计	10,981,687.09

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	4,985,950.05
股票投资	5,266,455.05
债券投资	-280,505.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
其他	—
合计	4,985,950.05

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	57,361.73
合计	57,361.73

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	6,400,155.75

银行间市场交易费用	—
合计	6,400,155.75

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
账户维护费	18,000.00
银行费用	9,045.83
上市费	29,752.78
其他	600.00
合计	255,752.89

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
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

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	0.00	0.00
兴业证券	-	-	680,959,219.55	6.88

6.4.7.1.2 债券交易

注：无。

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 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	-	-
兴业证券	620,559.67	6.83	620,559.67	15.43

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	13,412,941.92	13,281,437.75
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,721,026.14	1,745,665.74

注: 支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.5%/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
当期发生的基金应支付的托管费	2,235,490.33	2,213,572.98

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 X0.25%/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

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	6,900,814.92	400,188.47	351,491,180.76	1,136,878.10
------------	--------------	------------	----------------	--------------

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。

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

无。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 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	2017-01-18	2017-01-19	2017-01-18	0.20	8,722,163.41	20,277,398.45	28,999,561.86	-
合计	-	-	-	0.20	8,722,163.41	20,277,398.45	28,999,561.86	-

注：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，本报告期本基金不符合基金合同约定的收益分配条件，未有收益分配事项。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。

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	-
603305	旭升股	2017 年	2017-0	新股认购	11.26	11.26	1,351	15,212.2	15,212.2	-

	份	06月30日	7-10					6	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	-

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
300145	中金环境	2017-06-28	重大资产重组	16.92	-	-	2,700,000	31,803,549.73	45,684,000.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

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

注：无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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	1,666,889,381.38	91.90
	其中：股票	1,666,889,381.38	91.90
2	固定收益投资	90,081,000.00	4.97
	其中：债券	90,081,000.00	4.97
	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	20,000,000.00	1.10
	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	28,441,314.59	1.57
7	其他各项资产	8,302,472.57	0.46
	合计	1,813,714,168.54	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	69,432,000.00	3.85
C	制造业	1,242,041,879.41	68.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,936,000.00	1.05
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,629,561.17	7.07
J	金融业	208,849,940.80	11.57
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		
	合计	1,666,889,381.38	92.37

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	000063	中兴通讯	6,500,001	154,310,023.74	8.55
2	300323	华灿光电	9,000,067	124,920,929.96	6.92
3	600036	招商银行	5,000,021	119,550,502.11	6.62
4	601318	中国平安	1,800,029	89,299,438.69	4.95
5	002384	东山精密	3,599,938	88,918,468.60	4.93
6	603355	莱克电气	1,200,000	70,524,000.00	3.91
7	600547	山东黄金	2,400,000	69,432,000.00	3.85
8	300202	聚龙股份	4,000,055	66,080,908.60	3.66
9	600409	三友化工	6,300,000	63,441,000.00	3.52
10	002491	通鼎互联	4,200,081	56,449,088.64	3.13

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。

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	300323	华灿光电	141,309,921.11	7.56
2	000063	中兴通讯	127,380,913.26	6.82
3	600036	招商银行	111,003,004.43	5.94
4	000070	特发信息	91,535,122.61	4.90
5	601318	中国平安	86,036,209.94	4.60
6	002384	东山精密	85,283,488.89	4.56
7	000401	冀东水泥	80,537,845.63	4.31
8	603355	莱克电气	73,470,115.92	3.93
9	600409	三友化工	72,067,581.81	3.86
10	300078	思创医惠	67,471,030.93	3.61
11	300115	长盈精密	65,906,456.28	3.53
12	002491	通鼎互联	62,951,825.50	3.37

13	300418	昆仑万维	53,964,499.84	2.89
14	002138	顺络电子	53,713,048.40	2.87
15	002690	美亚光电	53,500,859.49	2.86
16	601166	兴业银行	50,428,412.96	2.70
17	000823	超声电子	45,141,084.93	2.42
18	000821	京山轻机	44,727,516.02	2.39
19	300308	中际装备	42,428,054.18	2.27
20	002042	华孚色纺	37,724,592.62	2.02
21	002179	中航光电	37,411,624.77	2.00

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	600266	北京城建	177,895,060.84	9.52
2	601166	兴业银行	110,301,991.28	5.90
3	600682	南京新百	84,250,681.76	4.51
4	000401	冀东水泥	80,584,389.12	4.31
5	000063	中兴通讯	72,122,792.74	3.86
6	000059	华锦股份	71,046,392.61	3.80
7	000070	特发信息	67,995,058.63	3.64
8	300115	长盈精密	65,138,962.69	3.49
9	600797	浙大网新	61,503,360.59	3.29
10	000998	隆平高科	59,125,208.89	3.16
11	000662	天夏智慧	57,907,397.33	3.10
12	601801	皖新传媒	57,343,623.77	3.07
13	600079	人福医药	52,534,232.21	2.81
14	002117	东港股份	50,301,683.84	2.69
15	002142	宁波银行	49,998,524.86	2.68
16	601939	建设银行	48,881,658.08	2.62
17	000823	超声电子	47,053,693.64	2.52
18	300408	三环集团	46,377,895.99	2.48
19	300308	中际装备	44,726,570.25	2.39
20	002019	亿帆医药	41,164,726.29	2.20
21	600547	山东黄金	39,656,350.47	2.12
22	300323	华灿光电	39,626,472.99	2.12
23	000687	华讯方舟	39,402,417.93	2.11
24	601009	南京银行	38,021,734.51	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	2,124,819,229.02
卖出股票收入（成交）总额	2,139,520,887.45

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	90,081,000.00	4.99
	其中：政策性金融债	90,081,000.00	4.99
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
	合计	90,081,000.00	4.99

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	140225	14 国开 25	300,000	30,057,000.00	1.67
2	140220	14 国开 20	300,000	30,039,000.00	1.66
3	120234	12 国开 34	300,000	29,985,000.00	1.66

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	803,556.42
2	应收证券清算款	4,558,799.28
3	应收股利	—
4	应收利息	2,878,101.03
5	应收申购款	62,015.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	8,302,472.57

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 (%)
53,249.00	26,335.85	1,371,498.34	0.10	1,400,985,980.75	99.90

8.2 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	4.88
2	张伟彬	1,371,000.00	2.10
3	曾立志	1,250,000.00	1.91

4	施建昌	1, 180, 179. 00	1. 81
5	郭红斌	1, 083, 299. 00	1. 66
6	张香芝	782, 037. 00	1. 20
7	陈文荪	527, 175. 00	0. 81
8	徐国英	498, 763. 00	0. 76
9	杨主恩	480, 000. 00	0. 74
10	孙涛	471, 724. 00	0. 72

8.3 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, 439. 00	0. 1220

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

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

§ 9 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	55, 348, 870. 67
减: 本报告期基金总赎回份额	105, 697, 876. 25
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, 402, 357, 479. 09

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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。

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

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、基金托管人的托管业务部门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	1,501,086,604.20	35.23	1,367,936.52	35.23	-
长江证券	1	787,408,386.99	18.48	717,566.32	18.48	-
英大证券	1	651,839,586.01	15.30	594,022.32	15.30	-
万和证券	1	447,815,429.50	10.51	408,088.56	10.51	-
中信建投	2	195,844,181.71	4.60	178,467.26	4.60	-
东吴证券	1	190,517,440.83	4.47	173,619.54	4.47	-
中银国际	1	169,537,191.51	3.98	154,499.15	3.98	-
中信证券	2	160,341,168.72	3.76	146,119.48	3.76	-
广发证券	2	86,170,648.13	2.02	78,523.98	2.02	-
西部证券	1	69,998,861.88	1.64	63,789.71	1.64	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	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。

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	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	245,000,000.00	2.65	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	197,554.64	3.69	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	2,968,000,000.00	32.13	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	5,151,766.41	96.31	2,209,000,000.00	23.91	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	616,000,000.00	6.67	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	3,200,000,000.00	34.64	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-