

# 南方益和保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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 2016 年 1 月 11 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
7.7 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.....	41
7.8 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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方益和保本混合型证券投资基金
基金简称	南方益和保本混合
基金主代码	002293
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 11 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,967,683,569.59 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“南方益和保本”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保障保本周期到期时本金安全的前提下，有效控制风险，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用恒定比例投资组合保险策略（Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI）来实现保本和增值的目标。恒定比例投资组合保险策略不仅能从投资组合资产配置层面上使基金保本到期日基金净值低于本金的概率最小化，而且还能在一定程度上使保本基金受益于股票市场在中长期内整体性上涨的特点。
业绩比较基准	三年期定期存款税后收益率+0.5%。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街一号楼一号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	吴万善	王洪章

## 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网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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

## 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
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司	深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 22/23 楼东

## § 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(2016 年 1 月 11 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	29,300,222.01
本期利润	42,968,136.37
加权平均基金份额本期利润	0.0144
本期加权平均净值利润率	1.43%
本期基金份额净值增长率	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	29,168,451.21
期末可供分配基金份额利润	0.0098
期末基金资产净值	3,010,496,171.96
期末基金份额净值	1.014
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.40%

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。
4. 基金合同生效日至本报告期末不满一年。

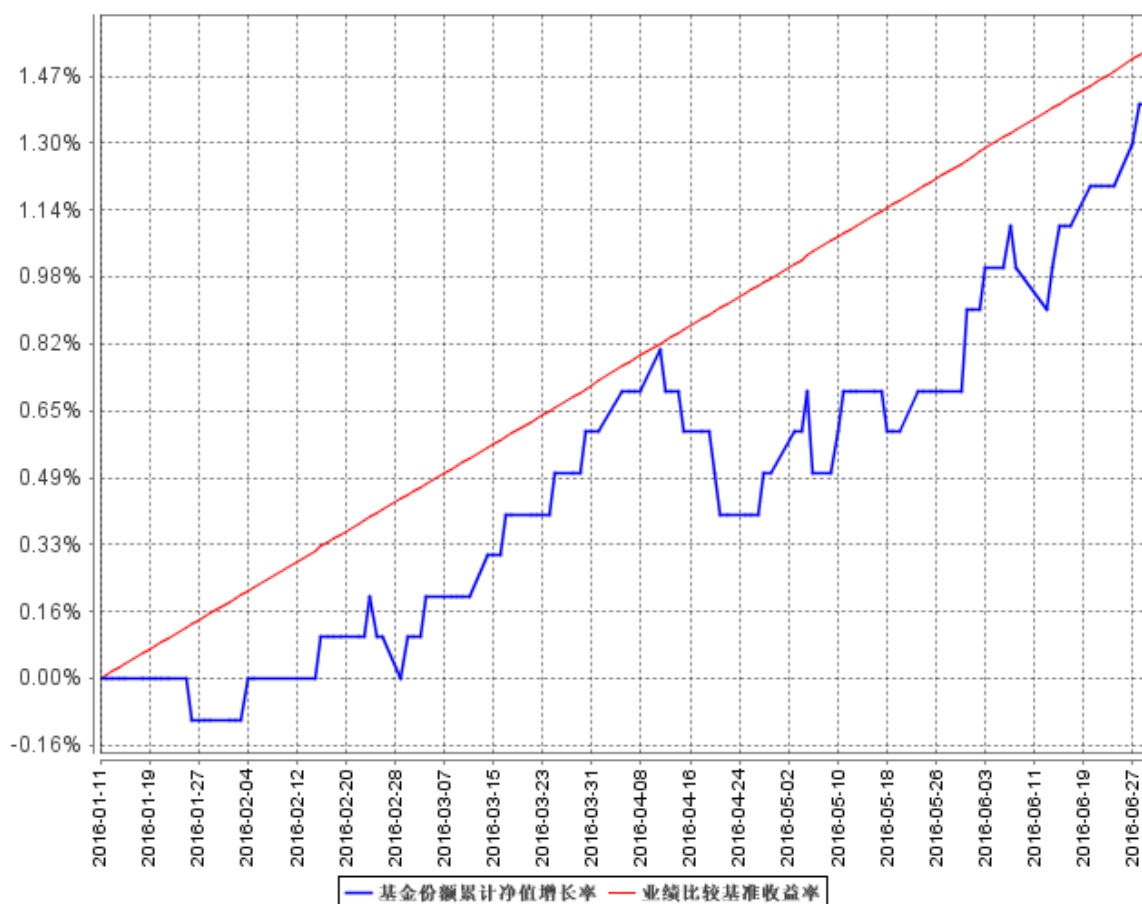
## 3.2 基金净值表现

### 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.50%	0.06%	0.26%	0.01%	0.24%	0.05%
过去三个月	0.80%	0.07%	0.81%	0.01%	-0.01%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.40%	0.06%	1.53%	0.01%	-0.13%	0.05%

### 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

基金份额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



注：1、基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截止本报告期末建仓期未结束。

2、本基金的第一个保本期为三年，自 2016 年 1 月 11 日至 2019 年 1 月 11 日止。

## § 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 5,600 亿元，旗下管理 96 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		
孙鲁闽	本基金基金经理	2016年1月11日	-	13年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003年4月加入南方基金管理有限公司，历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理，现任投资部副总监；2007年12月至2010年10月，担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2010年12月至今，任南方避险基金经理；2011年6月至今，任南方保本基金基金经理；2015年4月至今，任南方利淘基金经理；2015年5月至今，任南方利鑫基金经理；2015年5月至今，任南方丰合基金经理；2015年12月至今，任南方瑞利保本基金基金经理；2016年1月至今，任南方益和保本基金基金经理。
陈乐	本基金基金经理助理	2016年2月23日	-	8年	北京大学金融学硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金，历任研究部研究员、高级研究员，负责交运、有色、煤炭的行业研究；2016年2月至今，任南方避险、南方保本、南方利淘、南方利鑫、南方丰合、南方益和、南方瑞利的基金经理助理。

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《南方益和保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金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1次，是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

## 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

2016年上半年，人民币定价机制逐步完善，经历了先贬后升再贬的过程。国内食品价格出现上涨，工业品价格从底部反弹，并摆脱了几年的下降通道。上半年最大的黑天鹅事件是英国公投脱欧，美元、黄金等避险资产因此上涨。宏观经济方面，上半年统计局披露的PMI数据在50附近徘徊，表明经济出现了一定企稳迹象。

上半年权益市场震荡。上证综指收于2929，下跌17%；创业板指收于2227，下跌18%。年初投资者对人民币贬值的预期和对新股供给速度的担忧使得市场面临调整压力，而熔断机制在一定程度上限制了市场的流动性，加快了市场下跌的速度。此后指数窄幅波动，在基本平稳的情绪面和资金面下寻找估值中枢。6月份在MSCI没有纳入A股以及英国脱欧两大利空下，市场没有出现大幅下跌，表明市场可能探明了阶段性底部，市场情绪转而回升。上半年市场结构分化明显，热

点行业都取得了持续的超额收益，低估值、高分红价值股也取得了很好的表现。

上半年债券市场平稳向上，上证国债指数上涨 2.0%。信用风险频繁发生，除了产能过剩的传统行业、地方企业发生违约，还出现了央企的风险事件。市场对信用风险重新定价，同一评级下不同行业、不同区域的信用债风险溢价显著分化。

上半年本基金延续了此前的投资策略。股票投资上，本基金一方面继续投向低估值、高分红、具有安全边际的价值股，另一方面积极寻找具有竞争优势且有真正成长的白马股投资机会。债券投资上，本基金以短久期、高流动性、高评级的债券适当加杠杆进行配置来获取稳定的持有收益。二季度，在风险事件频发、市场大幅调升了信用风险溢价的情况下，本基金持有的债券因为低久期、高评级，并且规避传统产能过剩行业的债券，因此受到的冲击较小。在二季度债券收益率上行的情况下，本基金积极通过一级市场申购、二级市场购买债券提升了组合杠杆，之后债券收益率回落，这部分新增的债券配置取得了较好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年，本基金净值增长率为 1.40%。

#### 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，我们对后市保持谨慎乐观的态度。从经济层面来看，PMI、电厂耗煤量等数据显示实体经济有所好转，但未明显回升。从资金层面来看，股票市场的预期收益率逐步回归理性，资金仍在流动性充裕的背景下寻找可配置的资产。我们认为，随着市场利率中枢持续下行，保险及银行理财资金将面临严峻的再投资考验，低风险偏好的中长期机构投资者提升权益类资产配置比例将是大势所趋。以近期银行理财新规等监管政策的变化为例，我们认为监管层的思路是淡化收益，强调风控。而从被监管者角度来看，当其他提高收益率的途径都被挤压时，将更有动力在政策允许的范围内加大对权益市场的配置。由此我们认为，未来低估值高分红的个股仍将有很高的投资价值，价值类个股仍将持有持续的投资机会。

下半年，我们仍然会坚持以往的投资风格。权益投资方面，随着基金净值的增长，基金安全垫增厚，我们将会逐步增加股票仓位的配置。同时，我们会参照政策变化、市场情绪、技术指标等情况进行择时，对股票仓位进行一定调整。我们的核心组合仍然会以低估值、高分红的价值股为主，同时也会择机配置具有核心竞争力的成长股。债券投资方面，我们将继续采取持有到期的策略，选择中高评级的债券，保持组合的低久期和高流动性。

#### 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、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；本基金在保本基金阶段仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；转型为“南方益和灵活配置混合型证券投资基金”后，收益分配方式分为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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# § 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：南方益和保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	104,833,145.38
结算备付金		8,754,937.69
存出保证金		107,609.62
交易性金融资产	6.4.7.2	3,466,467,472.78
其中：股票投资		142,883,333.18
基金投资		-
债券投资		3,323,584,139.60
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	-
应收证券清算款		1,475,235.06
应收利息	6.4.7.5	37,517,957.22
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		3,619,156,357.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>

<b>负 债:</b>		
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		603,000,000.00
应付证券清算款		1,428,978.57
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,203,251.21
应付托管费		492,807.87
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	222,335.70
应交税费		-
应付利息		134,047.68
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	178,764.76
负债合计		608,660,185.79
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	2,967,683,569.59
未分配利润	6.4.7.10	42,812,602.37
所有者权益合计		3,010,496,171.96
负债和所有者权益总计		3,619,156,357.75

注: 1. 报告截止日 2016 年 06 月 30 日, 基金份额净值 1.014 元, 基金份额总额 2,967,683,569.59 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 01 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 06 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体: 南方益和保本混合型证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
<b>一、收入</b>		66,725,642.59
1.利息收入		37,827,492.28
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	6,414,881.97
债券利息收入		28,641,469.31
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,771,141.00
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		15,041,367.72
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	9,867,674.00

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,317,447.65
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	2,856,246.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,667,914.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	188,868.23
<b>减：二、费用</b>		23,757,506.22
1. 管理人报酬	6.4.9.4.1	18,197,073.55
2. 托管费	6.4.9.4.2	2,799,549.74
3. 销售服务费	6.4.9.4.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	552,941.53
5. 利息支出		2,005,827.11
其中：卖出回购金融资产支出		2,005,827.11
6. 其他费用	6.4.7.20	202,114.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		42,968,136.37
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		42,968,136.37

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方益和保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	42,968,136.37	42,968,136.37
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)	2,967,683,569.59	-155,534.00	2,967,528,035.59

其中：1.基金申购款	2,985,910,097.72	-	2,985,910,097.72
2.基金赎回款	-18,226,528.13	-155,534.00	-18,382,062.13
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）	2,967,683,569.59	42,812,602.37	3,010,496,171.96

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：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
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 基金基本情况

南方益和保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2794号《关于准予南方益和保本混合型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部部函[2016]50号《关于南方益和保本混合型证券投资基金备案确认的函》准予,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方益和保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集共募集2,985,910,097.72元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2016)第029号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方益和保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年1月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,985,910,097.72份基金份额,其中因截至2016年1月11日止,募集期仅为一个工作日,募集期间的有效认购参与款项未产生利息。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,担保人为深圳市高新投集团有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方益和保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市各类债券、股票、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化,按照投资组合保险机制对债券和股票的投资比例进行动态调整。其中,权益类资产占基金资产的比例不高于40%,固定收益类资产占基金资产的比例不低于60%,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款税后收益率+0.5%。



## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方益和保本混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 06 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于赎回引起的实收基金变动分别于基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则

期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

（3）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

（4）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债

券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	4,833,145.38
定期存款	100,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	100,000,000.00
其他存款	-
合计：	104,833,145.38

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	128,199,775.53	142,883,333.18	14,683,557.65	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	965,152,544.76	962,966,139.60	-2,186,405.16
	银行间市场	2,359,447,238.13	2,360,618,000.00	1,170,761.87
	合计	3,324,599,782.89	3,323,584,139.60	-1,015,643.29
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,452,799,558.42	3,466,467,472.78	13,667,914.36	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	852.04
应收定期存款利息	950,000.40
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,939.70
应收债券利息	36,563,116.68
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	48.40
合计	37,517,957.22

**6.4.7.6 其他资产**

注：无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	216,071.70
银行间市场应付交易费用	6,264.00
合计	222,335.70

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	178,764.76
合计	178,764.76

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
----	--------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,985,910,097.72	2,985,910,097.72
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-18,226,528.13	-18,226,528.13
- 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	2,967,683,569.59	2,967,683,569.59

#### 6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	29,300,222.01	13,667,914.36	42,968,136.37
本期基金份额交易产生的变动数	-131,770.80	-23,763.20	-155,534.00
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-131,770.80	-23,763.20	-155,534.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,168,451.21	13,644,151.16	42,812,602.37

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
活期存款利息收入	682,411.20
定期存款利息收入	5,699,472.61
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	32,459.26
其他	538.90
合计	6,414,881.97

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016
----	--------------------------------



	年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	139,474,054.86
减：卖出股票成本总额	129,606,380.86
买卖股票差价收入	9,867,674.00

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,317,447.65
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,317,447.65

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	274,131,615.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	258,926,219.31
减：应收利息总额	12,887,948.51
买卖债券差价收入	2,317,447.65

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,856,246.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,856,246.07

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	13,667,914.36
——股票投资	14,683,557.65
——债券投资	-1,015,643.29
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	13,667,914.36

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
基金赎回费收入	188,868.23
合计	188,868.23

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
交易所市场交易费用	536,641.53

银行间市场交易费用	16,300.00
合计	552,941.53

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
审计费用	48,314.80
信息披露费	130,449.96
其他	500.00
银行汇划费	19,489.53
账户维护费	3,360.00
合计	202,114.29

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.9.3 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.9.3.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	123,458,901.59	31.35%

#### 6.4.9.3.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华泰证券	942,163,584.76	98.29%

#### 6.4.9.3.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华泰证券	8,257,200,000.00	64.31%

#### 6.4.9.3.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.9.3.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月11日(基金合同生效日)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	114,026.09	31.57%	-	-

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。

#### 6.4.9.4 关联方报酬

##### 6.4.9.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,197,073.55
其中：支付销售机构的客户维护费	3,332,254.77

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 1.3%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×1.3%/当年天数。

##### 6.4.9.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,799,549.74

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

##### 6.4.9.4.3 销售服务费

注：无。

##### 6.4.9.5 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

##### 6.4.9.6 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.9.6.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及报告期内无关联方投资本基金的情况。

###### 6.4.9.6.2 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。

##### 6.4.9.7 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
	2016年1月11日(基金合同生效日)至2016年6月30日

	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	4,833,145.38	682,411.20

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.9.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.9.9 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 6.4.10 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.11 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

##### 6.4.11.2 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
300508	维宏股份	2016年6月30日	重大事项	254.50	2016年7月6日	242.00	10,383	208,490.64	2,642,473.50	-
600511	国药股	2016年2	重大事项	27.42	2016年8	30.16	60,000	1,721,955.71	1,645,200.00	-

	份	月 18 日			月 4 日					
601611	中国核 建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-
000651	格力电 器	2016 年 2 月 22 日	重大事项	22.07	-	-	20,000	377,600.00	441,400.00	-

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 603,000,000.00 元, 于 2016 年 7 月 11 日前到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

#### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只保本型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货及权证投资等。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, 控制本金损失的风险, 并在三年保本期到期时力争基金资产的稳定增值。

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

其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。

#### 6.4.12.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

#### 6.4.12.3 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股票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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.11 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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的



公允价值。

于 2016 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 603,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	104,833,145.38	-	-	-	104,833,145.38
结算备付金	8,754,937.69	-	-	-	8,754,937.69
存出保证金	107,609.62	-	-	-	107,609.62
交易性金融资产	2,264,390,448.30	1,059,193,691.30	-	142,883,333.18	3,466,467,472.78
应收证券清算款	-	-	-	1,475,235.06	1,475,235.06
应收利息	-	-	-	37,517,957.22	37,517,957.22
资产总计	2,378,086,140.99	1,059,193,691.30	-	181,876,525.46	3,619,156,357.75
负债					
卖出回购金融资产款	603,000,000.00	-	-	-	603,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,428,978.57	1,428,978.57
应付管理人报酬	-	-	-	3,203,251.21	3,203,251.21
应付托管费	-	-	-	492,807.87	492,807.87
应付交易费用	-	-	-	222,335.70	222,335.70

应付利息	-	-	-	134,047.68	134,047.68
其他负债	-	-	-	178,764.76	178,764.76
负债总计	603,000,000.00	-	-	5,660,185.79	608,660,185.79
利率敏感度缺口	1,775,086,140.99	1,059,193,691.30	-	176,216,339.67	3,010,496,171.96

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

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	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（2016年6月30日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 827
	2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 821

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 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。本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对债券和股票的投资比例进行动态调整。本基金投资组合中权益类资产投资比例为基金资产的 0-40%，固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。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。

#### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	142,883,333.18	4.75	-	-
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	142,883,333.18	4.75	-	-

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.75%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	142,883,333.18	3.95
	其中：股票	142,883,333.18	3.95
2	固定收益投资	3,323,584,139.60	91.83
	其中：债券	3,323,584,139.60	91.83
	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	-	-
	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	113,588,083.07	3.14
7	其他各项资产	39,100,801.90	1.08
8	合计	3,619,156,357.75	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	91,965,350.12	3.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,358,202.00	0.28
E	建筑业	9,823,628.28	0.33
F	批发和零售业	1,645,200.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	1,375,000.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,314,165.90	0.11
J	金融业	12,776,870.78	0.42
K	房地产业	10,250,100.00	0.34
L	租赁和商务服务业	143,990.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	3,210,700.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	142,883,333.18	4.75

## 7.3 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	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例 (%)
1	000895	双汇发展	800,844	16,721,622.72	0.56
2	000333	美的集团	470,750	11,166,190.00	0.37
3	600068	XD 葛洲坝	1,554,700	9,048,354.00	0.30
4	600741	华域汽车	600,000	8,406,000.00	0.28
5	600266	北京城建	610,000	7,618,900.00	0.25
6	002792	通宇通讯	116,431	6,962,573.80	0.23
7	002117	东港股份	180,000	5,662,800.00	0.19
8	002142	宁波银行	380,200	5,619,356.00	0.19
9	000858	五粮液	170,001	5,530,132.53	0.18
10	600886	国投电力	800,000	5,280,000.00	0.18
11	002563	森马服饰	450,700	4,881,081.00	0.16
12	600978	宜华生活	370,000	4,121,800.00	0.14
13	601166	兴业银行	220,000	3,352,800.00	0.11
14	600983	惠而浦	270,000	3,348,000.00	0.11
15	000568	泸州老窖	110,400	3,278,880.00	0.11
16	600273	嘉化能源	310,100	2,762,991.00	0.09
17	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.09
18	000786	北新建材	280,000	2,542,400.00	0.08
19	000910	大亚科技	160,000	2,472,000.00	0.08
20	601098	中南传媒	120,000	2,173,200.00	0.07
21	000001	平安银行	240,000	2,088,000.00	0.07
22	000543	皖能电力	279,300	1,994,202.00	0.07
23	601566	九牧王	128,900	1,990,216.00	0.07
24	600511	国药股份	60,000	1,645,200.00	0.05
25	000650	仁和药业	199,927	1,631,404.32	0.05
26	002671	龙泉股份	131,500	1,624,025.00	0.05
27	000429	粤高速 A	250,000	1,375,000.00	0.05
28	600894	广日股份	90,000	1,199,700.00	0.04
29	600681	百川能源	100,000	1,084,000.00	0.04
30	601677	明泰铝业	79,902	1,065,892.68	0.04
31	600373	中文传媒	50,000	1,037,500.00	0.03
32	002242	九阳股份	50,000	909,000.00	0.03
33	601009	南京银行	96,402	905,214.78	0.03
34	600684	珠江实业	120,000	901,200.00	0.03
35	000671	阳光城	150,000	891,000.00	0.03
36	600708	光明地产	100,000	839,000.00	0.03
37	600030	中信证券	50,000	811,500.00	0.03
38	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03

39	600660	福耀玻璃	50,000	700,000.00	0.02
40	600885	宏发股份	20,000	614,200.00	0.02
41	000997	新大陆	30,000	601,200.00	0.02
42	002434	万里扬	50,000	544,000.00	0.02
43	002078	太阳纸业	100,000	488,000.00	0.02
44	000404	华意压缩	50,000	481,000.00	0.02
45	000651	格力电器	20,000	441,400.00	0.01
46	300301	长方集团	50,000	423,500.00	0.01
47	002470	金正大	50,000	402,500.00	0.01
48	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
49	002191	劲嘉股份	18,500	214,415.00	0.01
50	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
51	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
52	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
53	300296	利亚德	4,700	148,802.00	0.00
54	002258	利尔化学	15,700	147,423.00	0.00
55	603117	万林股份	7,700	143,990.00	0.00
56	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
57	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
58	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
59	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
60	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
61	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
62	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
63	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
64	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
65	002805	丰元股份	971	5,631.80	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000895	双汇发展	17,605,551.21	0.58
2	000333	美的集团	10,583,589.00	0.35
3	002117	东港股份	9,686,923.11	0.32
4	600741	华域汽车	9,375,347.64	0.31

5	600068	葛洲坝	9,196,103.78	0.31
6	601166	兴业银行	7,288,812.88	0.24
7	600266	北京城建	7,284,316.03	0.24
8	002142	宁波银行	7,219,661.00	0.24
9	600886	国投电力	5,593,100.00	0.19
10	002563	森马服饰	5,587,971.00	0.19
11	000858	五粮液	5,153,225.62	0.17
12	600273	嘉化能源	4,649,337.00	0.15
13	000404	华意压缩	4,376,618.12	0.15
14	600978	宜华生活	4,184,974.00	0.14
15	600269	赣粤高速	4,058,086.00	0.13
16	000910	大亚科技	4,041,887.40	0.13
17	000543	皖能电力	3,515,481.00	0.12
18	002242	九阳股份	3,246,353.37	0.11
19	600983	惠而浦	3,228,124.00	0.11
20	000568	泸州老窖	3,141,405.00	0.10

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000404	华意压缩	4,343,005.10	0.14
2	600269	赣粤高速	4,096,604.00	0.14
3	000418	小天鹅A	4,066,506.62	0.14
4	002117	东港股份	3,867,273.00	0.13
5	601166	兴业银行	3,632,066.14	0.12
6	002152	广电运通	3,340,572.89	0.11
7	601616	广电电气	2,775,415.00	0.09
8	002339	积成电子	2,716,408.00	0.09
9	000058	深赛格	2,662,041.00	0.09
10	600885	宏发股份	2,613,509.72	0.09
11	000895	双汇发展	2,606,524.00	0.09
12	002242	九阳股份	2,588,405.00	0.09
13	300011	鼎汉技术	2,570,629.00	0.09
14	002016	世荣兆业	2,421,184.76	0.08

15	600273	嘉化能源	2,386,526.43	0.08
16	000158	常山股份	2,358,038.00	0.08
17	600496	精工钢构	2,353,001.39	0.08
18	600270	外运发展	2,307,442.00	0.08
19	000488	晨鸣纸业	2,281,465.17	0.08
20	600573	惠泉啤酒	2,210,418.40	0.07

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	257,806,156.39
卖出股票收入（成交）总额	139,474,054.86

### 7.5 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	242,579,733.90	8.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	719,500,405.70	23.90
5	企业短期融资券	1,952,226,000.00	64.85
6	中期票据	408,392,000.00	13.57
7	可转债（可交换债）	886,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,323,584,139.60	110.40

### 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（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019518	15 国债 18	1,986,770	198,657,132.30	6.60
2	101551100	15 联通 MTN003	1,300,000	131,248,000.00	4.36
3	122465	15 广越 01	867,000	88,364,640.00	2.94



4	136039	15 石化 01	841,000	85,361,500.00	2.84
5	011699354	16 核风电 SCP001	800,000	80,064,000.00	2.66

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 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

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 7.12.2

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。

### 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	107,609.62
2	应收证券清算款	1,475,235.06
3	应收股利	-
4	应收利息	37,517,957.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	39,100,801.90

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
13,574	218,630.00	1,271,882,418.91	42.86%	1,695,801,150.68	57.14%

### 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	694,418.70	0.0234%

### 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
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（2016年1月11日）基金份额总额	2,985,910,097.72
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	18,226,528.13
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,967,683,569.59

## § 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

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

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	
中金公司	1	206,976,340.85	52.56%	188,502.05	52.19%	-
华泰证券	1	123,458,901.59	31.35%	114,026.09	31.57%	-
第一创业	1	19,034,622.03	4.83%	17,713.66	4.90%	-
齐鲁证券	1	16,987,204.19	4.31%	15,819.04	4.38%	-
民族证券	1	9,420,800.21	2.39%	8,585.20	2.38%	-
安信证券	1	8,979,827.55	2.28%	8,363.02	2.32%	-
招商证券	1	8,936,801.79	2.27%	8,144.14	2.26%	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

### 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	
	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
华泰证券	942,163,584.76	98.29%	8,257,200,000.00	64.31%	-	-
第一创业	12,850,378.03	1.34%	2,659,200,000.00	20.71%	-	-
齐鲁证券	1,090,496.09	0.11%	1,601,000,000.00	12.47%	-	-
中金公司	2,448,415.44	0.26%	-	-	-	-
安信证券	-	-	321,500,000.00	2.50%	-	-

民族证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

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。

## 10.8 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	中国证券报、上海证	2016年6月23日

	余杭农村商业银行作为代销机构及开通相关业务的公告	券报、证券时报	
2	南方基金关于旗下部分基金增加泰隆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	2016年6月3日
3	南方基金关于旗下部分基金增加宁波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	2016年6月2日
4	南方基金关于旗下部分基金增加汇成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	2016年5月13日
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	2016年5月12日
6	南方基金关于旗下部分基金增加天津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	2016年5月10日
7	南方基金关于旗下部分基金增加徽商银行和广东南粤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	2016年4月20日
8	南方基金关于旗下部分基金增加徽商期货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	2016年4月18日
9	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月12日
10	南方益和保本混合型证券投资基金开放赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月25日
11	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇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	2016年3月9日

12	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	2016 年 2 月 26 日
13	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 日
14	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 27 日
15	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛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	2016 年 1 月 26 日
16	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
17	南方益和保本混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
18	关于南方益和保本混合型证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 9 日
19	南方益和保本混合型证券投资基金募集期提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 8 日
20	南方基金关于南方益和保本基金增加招商银行和南充市商业银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 7 日
21	南方益和保本混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
22	南方益和保本混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
23	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 5 日

24	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日
----	--------------------------------------	------------------	----------------

## § 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益和保本混合型证券投资基金的文件。
- 2、南方益和保本混合型证券投资基金基金合同。
- 3、南方益和保本混合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>