

# 南方绩优成长混合型证券投资基金 2017 年 半年度报告

2017 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 08 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

### §1 重要提示及目录

- 1.1 重要提示
- 1.2 目录

### §2 基金简介

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

- 3.1 主要会计数据和财务指标
- 3.2 基金净值表现

### §4 管理人报告

- 4.1 基金管理人及基金经理情况
- 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明
- 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
- 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
- 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
- 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
- 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
- 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

### §5 托管人报告

- 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明
- 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
- 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

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

### §7 投资组合报告

- 7.1 期末基金资产组合情况
- 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
  - 7.4.1 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
- 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

- 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
- 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
- 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
- 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
- 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 7.12 投资组合报告附注

## § 8 基金份额持有人信息

- 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
- 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
- 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

## § 9 开放式基金份额变动

## § 10 重大事件揭示

- 10.1 基金份额持有人大会决议
- 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
- 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
- 10.4 基金投资策略的改变
- 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
- 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
- 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
- 10.8 其他重大事件

## § 11 备查文件目录

- 11.1 备查文件目录
- 11.2 存放地点
- 11.3 查阅方式

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方绩优成长混合型证券投资基金	
基金简称	南方绩优成长混合	
场内简称	南方绩优	
基金主代码	202003	
交易代码	202003 (前端)	202004 (后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 11 月 16 日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,644,030,923.50 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“南方绩优”。

### 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，根据对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡与精选，力争为投资者寻求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。
投资策略	本基金的股票投资主要采用“自下而上”的策略，通过对上市公司基本面的深入研究，基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡，不仅重视公司的业绩与成长性，更注重公司的业绩与成长性的质量，精选中长期持续增长或未来阶段性高速增长、业绩质量优秀、且价值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金的股票投资同时结合“自上而下”的行业分析，根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。本基金将优先选择具有良好的行业增长空间，所处行业结构相对稳定，在产业链中处于优势地位或上下游运行态势好转，具有一定的垄断竞争优势，公司治理结构透明完善，管理水平领先的上市公司。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数 + 20%×上证国债指数
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		张海波	易会满

### 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	深圳市福田区中心区福华一路 6 号免税商务大厦塔楼 31-33 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日-2017年6月30日）
本期已实现收益	103,563,162.17
本期利润	678,379,318.76
加权平均基金份额本期利润	0.1471
本期加权平均净值利润率	15.70%
本期基金份额净值增长率	16.96%
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	-112,124,697.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0241
期末基金资产净值	4,710,528,638.61
期末基金份额净值	1.0143
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	315.17%

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

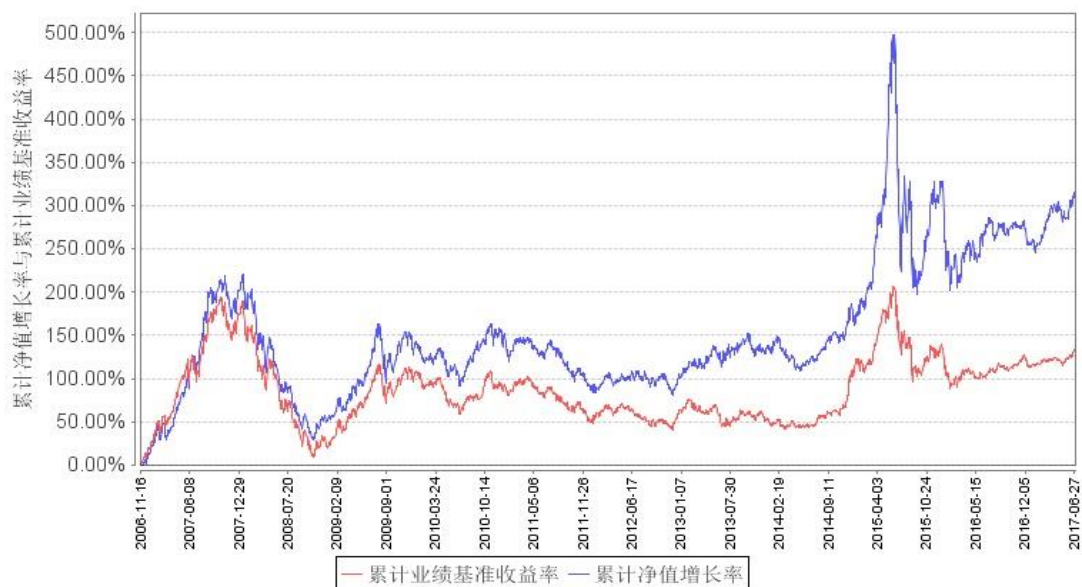
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.46%	0.90%	4.01%	0.54%	3.45%	0.36%
过去三个月	4.86%	0.88%	4.90%	0.49%	-0.04%	0.39%
过去六个月	16.96%	0.81%	8.65%	0.45%	8.31%	0.36%
过去一年	10.39%	0.84%	13.30%	0.54%	-2.91%	0.30%

过去三年	85.71%	1.97%	59.07%	1.40%	26.64%	0.57%
自基金合同生效起至今	315.17%	1.70%	132.52%	1.50%	182.65%	0.20%

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

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。南方基金总部设在深圳，注册资本 3 亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 6,500 亿元，旗下管理 134 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
骆帅	本基金基金经理	2016 年 12 月 28 日		8	清华大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格，2009 年 7 月加入南方基金，担任研究部研究员、高级研究员；2014 年 3 月至 2015 年 5 月，任南方成份、南方安心基金经理助理；2015 年 5 月至今，任南方高端装备基金经理；2015 年 6 月至今，任南方价值、南方成长基金经理；2016 年 12 月至今，任南方绩优基金经理。
熊琳	本基金助理	2012 年 3 月 15 日		11	女，上海财经大学财务管理硕士，具有基金从业资格；曾担任中投证券研究所资深分析师，并获得新财富排名第六；2010 年 5 月加入南方基金，担任研究部电子设备及新能源行业高级研究员；2012 年 3 月至今，任南方绩优基金经理助理。
史博	本基金基金经理	2011 年 2 月 17 日		19	特许金融分析师（CFA），硕士学历，具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004 年 7 月至 2005 年 2 月，任泰达周期基金经理；2007 年 7 月至 2009 年 5 月任泰达首选基金经理；2008 年 8 月至 2009 年 9 月任泰达市值基金经理；2009 年 4 月至 2009 年 9 月任泰达品质基金经理。2009 年 10 月加入南方基金，现任南方基金总裁助理兼首席投资官（权益）、资产配置委员会主席、境内权益投资决策委员会主席、国际投资决策委员会主席、公募业务协同发展委员会副主席。2011 年 2 月至今，任南方绩优基金经理；2014 年 2 月至今，任南方

					新优享基金经理；2015 年 9 月至今，任南方消费活力基金经理；2017 年 3 月至今，任南方智慧混合基金经理。
--	--	--	--	--	--

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《南方绩优成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、投资比例及投资组合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、卖出溢价率、交易占优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

宏观方面，上半年国内经济较为强势，GDP 增速连续两个季度维持在 6.9% 的高位，主要是固定资产投资超预期，三四线城市强劲的房地产销售和投资贡献较大，同时财政支出节奏也相对往年更高，1-6 月份支出是全年预算的 53%，过去十多年以来最高，预计下半年将放缓。同时由于去年下半年基数效应，今年下半年房地产投资和汽车销量增速可能会有所放缓。货币政策方面，央行上半年两次上调公开市场利率，流动性并不宽松。央行一季度货币执行报告指明货币政策基调与监管政策节奏，市场悲观预期缓解。国际上，全球经济 U 型复苏，欧洲英国央行转向鹰派，欧

元、英镑持续升值而美元走弱，上半年美元跌幅达到 6.6%，人民币贬值压力大减。

市场方面，上半年风格分化较大，以上证 50 为代表的低估值绩优蓝筹涨幅较大，而部分高估值低增长的板块下跌明显。行业上，以家电、白酒、保险、银行、电子等中低估值、基本面中长期逻辑清晰的板块占优，高估值的国防军工、传媒、计算机等板块下跌较多。二季度以来分化幅度有所收窄，不过大方向依然延续了上述趋势。二季度末 A 股正式纳入 MSCI 指数。

报告期内，本基金在仓位上保持中等偏高水平；配置方面，仍然着重于以家电、食品饮料、家装建材为代表的消费产业，以智能终端为代表的的电子制造业，以新能源汽车为代表的新兴科技行业。同时，增大了金融、地产的配置，尤其是保险行业的配置。保险行业的治理整顿有利于传统的优势企业凸显竞争优势，从重视资产端到重视负债端，回归保险业务本源，提升长期竞争力。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年，南方绩优成长基金净值增长 16.96%，同期业绩比较基准增长 8.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来几个季度，我们认为本轮房地产周期正处于繁荣顶点附近，但是制造业投资周期刚刚开启。从去年三季度开始的企业资本开支周期有利于减缓经济下行风险；今年一季度制造业资产周转率同比增速首次转正（6 年来），这往往是制造业 ROE 好转的重要标志，也预示着企业资本开支将继续好转。中长期展望则更为乐观，产业持续升级、竞争格局改善，企业利润仍将继续回升。但在流动性方面，整体资金面偏紧的情况仍然看不到改善的迹象，将导致指数向上空间有限。因此市场将继续在较窄区间震荡上行。风格上，白马龙头股估值提升尚未结束。现在一些行业龙头都处于一个估值向海外成熟市场靠拢的过程中，目前看没有结束的迹象，这是经济增速趋缓、投资者结构变化、竞争格局优化、资本市场开放以及 IPO 加速的共同结果，背后驱动力强劲而持续，并不是一个短暂的风口，资金会持续从估值虚高的股票流向这些龙头股票。

鉴于此，我们在配置上仍然以竞争格局持续改善的龙头白马为主，不追求当期利润增速特别高，但要求竞争格局清晰、龙头竞争力强且份额能够持续提升、长期能看到比较大的市场空间（包括国际市场）。换句话说，在盈利的“持续性”和“成长性”上赋予同等重要的权重，并灵活把握仓位变化，力争为持有人创造超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在

0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、权益研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每类基金份额的每年收益分配次数最多为 12 次，各基金份额类别全年分配比例不得低于该类基金份额年度可供分配收益的 90%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金 A 类基金份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；目前本基金 H 类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金 H 类基金份额可增加红利再投资的收益分配方式供 H 类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如 H 类基金份额持有人未选择，本基金 H 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；同一类别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收益分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方绩优成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，南方绩优成长混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方绩优成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方绩优成长混合型证券投资基金对基金份额持有人未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方绩优成长混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：南方绩优成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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	600,933,228.58	182,328,883.52
结算备付金		12,311,820.41	3,254,307.26
存出保证金		1,140,950.07	1,327,929.24
交易性金融资产	6.4.4.2	4,109,787,613.93	3,353,576,522.25
其中：股票投资		3,852,120,455.53	3,116,078,389.85
基金投资		-	-
债券投资		257,667,158.40	237,498,132.40
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	-	520,718,076.08
应收证券清算款		-	6,838,189.43
应收利息	6.4.4.5	2,718,679.20	5,481,243.47
应收股利		28,000.00	28,000.00
应收申购款		1,282,853.79	265,920.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		4,728,203,145.98	4,073,819,071.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		45,794.55	54,566,841.12
应付赎回款		3,344,264.70	2,355,918.58
应付管理人报酬		5,630,035.62	5,223,169.36
应付托管费		938,339.28	870,528.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	7,503,870.76	3,650,927.10
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	212,202.46	311,822.45
负债合计		17,674,507.37	66,979,206.87
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.4.9	4,644,030,923.50	4,620,537,741.72
未分配利润	6.4.4.10	66,497,715.11	-613,697,877.01
所有者权益合计		4,710,528,638.61	4,006,839,864.71
负债和所有者权益总计		4,728,203,145.98	4,073,819,071.58

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,644,030,923.50 份（均为 A 类基金份额），A 类基金份额净值 1.0143 元；无 H 类基金份额。

## 6.2 利润表

会计主体：南方绩优成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
<b>一、收入</b>		728,276,275. 39	-616,299,171. 57
1. 利息收入		7,385,759.97	5,204,345.40
其中：存款利息收入	6.4.4.11	1,753,649.97	1,907,519.27
债券利息收入		3,119,451.63	2,871,570.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,512,658.37	425,255.24
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		145,860,986. 00	-388,696,604. 33
其中：股票投资收益	6.4.4.12.1	117,597,603. 58	-409,144,105. 30
基金投资收益	6.4.4.13	-	-
债券投资收益	6.4.4.14.1	266,700.00	240,724.72
资产支持证券投资收益	6.4.4.14.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	-	-
股利收益	6.4.4.17	27,996,682.42	20,206,776.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	574,816,156.59	-233,043,339.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	213,372.83	236,426.48
<b>减：二、费用</b>		49,896,956.6	52,401,219.80

		3	
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	32,037,457.26	30,737,371.00
2. 托管费	6.4.7.2.2	5,339,576.23	5,122,895.19
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.20	12,296,360.18	16,306,666.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.21	223,562.96	234,287.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		678,379,318.76	-668,700,391.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		678,379,318.76	-668,700,391.37

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方绩优成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）	4,620,537,741.72	-613,697,877.01	4,006,839,864.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	678,379,318.76	678,379,318.76
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）	23,493,181.78	1,816,273.36	25,309,455.14
其中：1. 基金申购款	359,141,358.65	-15,739,784.46	343,401,574.19
2. 基金赎回款	-335,648,176.87	17,556,057.82	-318,092,119.05
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）	4,644,030,923.50	66,497,715.11	4,710,528,638.61
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）	2,746,071,199.03	2,930,360,842.83	5,676,432,041.86



值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-668,700,391.37	-668,700,391.37
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)	2,118,336,341.82	-324,737,803.63	1,793,598,538.19
其中:1.基金申购款	2,386,595,204.90	-347,851,213.63	2,038,743,991.27
2.基金赎回款	-268,258,863.08	23,113,410.00	-245,145,453.08
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)	-	-2,331,750,401.63	-2,331,750,401.63
五、期末所有者权益(基金净值)	4,864,407,540.85	-394,827,753.80	4,469,579,787.05

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 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 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	600,933,228.58
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	600,933,228.58

##### 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	3,206,952,445.02	3,852,120,455.53	645,168,010.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	17,855,158.40	1,211,158.40
	银行间市场	239,812,000.00	-422,680.00

	合计	256,878,680.00	257,667,158.40	788,478.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	3,463,831,125.02	4,109,787,613.93	645,956,488.91

#### 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

注：无。

##### 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	110,659.65
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	4,986.36
应收债券利息	2,602,571.13
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	462.06
合计	2,718,679.20

#### 6.4.4.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,503,020.76
银行间市场应付交易费用	850.00
合计	7,503,870.76

## 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	8,886.97
预提费用	203,315.49
合计	212,202.46

## 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	4,620,537,741.72	4,620,537,741.72
本期申购	359,141,358.65	359,141,358.65
本期赎回（以“-”号填列）	-335,648,176.87	-335,648,176.87
-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	4,644,030,923.50	4,644,030,923.50

注：：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-215,573,871.39	-398,124,005.62	-613,697,877.01
本期利润	103,563,162.17	574,816,156.59	678,379,318.76
本期基金份额交易产生的变动数	-113,988.73	1,930,262.09	1,816,273.36
其中：基金申购款	-18,026,832.40	2,287,047.94	-15,739,784.46
基金赎回款	17,912,843.67	-356,785.85	17,556,057.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-112,124,697.95	178,622,413.06	66,497,715.11

## 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	1,600,457.57
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	137,705.77
其他	15,486.63
合计	1,753,649.97

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	117,597,603.58
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	117,597,603.58

##### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	4,067,213,633.98
减：卖出股票成本总额	3,949,616,030.40
买卖股票差价收入	117,597,603.58

#### 6.4.4.13 基金投资收益

注：无。

#### 6.4.4.14 债券投资收益

##### 6.4.4.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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	266,700.00
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	266,700.00

## 6.4.4.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	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	235,592,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	229,733,300.00
减：应收利息总额	5,592,000.00
买卖债券差价收入	266,700.00

## 6.4.4.14.3 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	27,996,682.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	27,996,682.42

## 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	574,816,156.59
股票投资	574,176,510.59
债券投资	639,646.00
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	574,816,156.59

**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	196,973.22
补差费归资产	16,399.61
合计	213,372.83

**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	12,295,010.18
银行间市场交易费用	1,350.00
合计	12,296,360.18

**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	54,547.97
信息披露费	148,767.52
账户维护费	18,600.00
银行汇划费	1,647.47
合计	223,562.96

**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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
--------------------	-----------------

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。

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
兴业证券	-	-%	1,742,476,587.06	16.49%

###### 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华泰证券	9,028,000.00	100.00%	-	-%

###### 6.4.7.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 6.4.7.1.4 基金交易

注：无。

###### 6.4.7.1.5 权证交易

注：无。

###### 6.4.7.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
-------	----------------------------



	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	1,587,921.98	16.38%	1,351,546.17	28.14%

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	32,037,457.26	30,737,371.00
其中：支付销售机构的客户维护费	3,693,740.95	3,651,650.95

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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$ 。

##### 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	5,339,576.23	5,122,895.19

注：支付基金托管人中国工商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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

##### 6.4.7.2.3 销售服务费

注：无。

**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:本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**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:本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**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:本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	600,933,228.58	1,600,457.57	379,002,214.27	1,795,487.28

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

**6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注:无。

**6.4.7.7 其他关联交易事项的说明**

注:无。

**6.4.8 利润分配情况**

注:无。

**6.4.9 期末本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股认购	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股认购	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股认购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股认购	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股认购	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

#### 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
000700	模塑科技	2017-06-27	重大事项	8.09	2017-08-16	8.00	7,958,376	67,642,012.83	64,383,261.84	-
603501	韦尔股份	2017-06-02	重大事项	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

##### 6.4.9.3.1 交易所市场债券正回购

注：无。

#### 6.4.10 金融工具风险及管理

##### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门

合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中

变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 6.4.9 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，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。本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.10.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.10.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	600,933,228.58	-	-	-	600,933,228.58
结算备付金	12,311,820.41	-	-	-	12,311,820.41
存出保证金	1,140,950.07	-	-	-	1,140,950.07
交易性金融资产	250,245,659.60	7,421,498.80	-	3,852,120,455.53	4,109,787,613.93
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	-2,718,679.20	2,718,679.20
应收股利	-	-	-	28,000.00	28,000.00
应收申购款	1,282,853.79	-	-	-	1,282,853.79
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	865,914,512.45	7,421,498.80	-	3,854,867,134.73	4,728,203,145.98
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-3,344,264.70	3,344,264.70
应付管理人报酬	-	-	-	-5,630,035.62	5,630,035.62
应付托管费	-	-	-	-938,339.28	938,339.28
应付证券清算款	-	-	-	-45,794.55	45,794.55
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-7,503,870.76	7,503,870.76
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-212,202.46	212,202.46
负债总计	-	-	-	17,674,507.37	17,674,507.37
利率敏感度缺口	865,914,512.45	7,421,498.80	-	3,837,192,627.36	4,710,528,638.61
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	182,328,883.52	-	-	-	182,328,883.52
结算备付金	3,254,307.26	-	-	-	3,254,307.26
存出保证金	1,327,929.24	-	-	-	1,327,929.24
交易性金融资产	229,751,000.00	7,747,132.40	-	3,116,078,389.85	3,353,576,522.25
买入返售金融资产	520,718,076.08	-	-	-	520,718,076.08
应收证券清算款	-	-	-	-6,838,189.43	6,838,189.43
应收利息	-	-	-	-5,481,243.47	5,481,243.47
应收股利	-	-	-	28,000.00	28,000.00
应收申购款	14,545.10	-	-	251,375.23	265,920.33
资产总计	937,394,741.20	7,747,132.40	-	3,128,677,197.98	4,073,819,071.58
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	54,566,841.12	54,566,841.12
应付赎回款	-	-	-	-2,355,918.58	2,355,918.58
应付管理人报酬	-	-	-	-5,223,169.36	5,223,169.36

应付托管费	-	-	-	870,528.26	870,528.26
应付交易费用	-	-	-	3,650,927.10	3,650,927.10
其他负债	-	-	-	311,822.45	311,822.45
负债总计	-	-	-	66,979,206.87	66,979,206.87
利率敏感度缺口	937,394,741.20	7,747,132.40	-	3,061,697,991.11	4,006,839,864.71

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。

#### 6.4.10.4.1.2 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		
	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：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-8,090,000.00	-
	市场利率下降 25 个基点	8,110,000.00	-

#### 6.4.10.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金组合投资的范围中股票占基金资产净值的 60%-95%；现金、债券、货币市场工具以及权证等其他金融工具占基金资产净值的 5%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有

的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.10.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,852,120,455.53	81.78	3,116,078,389.85	77.77
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	3,852,120,455.53	81.78	3,116,078,389.85	77.77

#### 6.4.10.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	209,862,000.00	158,640,000.00
	沪深 300 指数下降 5%	-209,862,000.00	-158,640,000.00

#### 6.4.10.4.3 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购



入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,852,120,455.53	81.47
	其中：股票	3,852,120,455.53	81.47
2	固定收益投资	257,667,158.40	5.45
	其中：债券	257,667,158.40	5.45
	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	613,245,048.99	12.97
7	其他各项资产	5,170,483.06	0.11
8	合计	4,728,203,145.98	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	32,662,475.68	0.69
B	采矿业	7,537,936.56	0.16
C	制造业	2,902,362,198.92	61.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,189,828.92	0.47
E	建筑业	38,778.24	-
F	批发和零售业	29,721,510.40	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	54,520,003.98	1.16
H	住宿和餐饮业	31,493,765.12	0.67
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,619,695.42	0.73
J	金融业	438,636,571.03	9.31
K	房地产业	152,579,822.62	3.24
L	租赁和商务服务业	61,976,645.84	1.32
M	科学研究和技术服务业	9,840,000.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	40,592,287.80	0.86
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	33,348,935.00	0.71
S	综合	-	-
	合计	3,852,120,455.53	81.78

### 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	000651	格力电器	11,265,593	463,804,463.81	9.85
2	600196	复星医药	6,499,991	201,434,721.09	4.28
3	002035	华帝股份	7,520,001	181,984,024.20	3.86
4	002043	兔宝宝	10,181,844	140,916,720.96	2.99
5	002841	视源股份	1,728,522	128,290,902.84	2.72
6	600036	招商银行	5,299,933	126,721,398.03	2.69
7	600660	福耀玻璃	4,399,821	114,571,338.84	2.43
8	002271	东方雨虹	2,999,905	111,296,475.50	2.36
9	002597	金禾实业	5,000,041	109,300,896.26	2.32
10	601601	中国太保	3,150,820	106,718,273.40	2.27
11	600383	金地集团	8,948,546	102,639,822.62	2.18
12	600872	中炬高新	5,229,442	95,698,788.60	2.03
13	601336	新华保险	1,853,185	95,253,709.00	2.02
14	002705	新宝股份	6,260,997	94,102,784.91	2.00
15	000910	大亚圣象	3,561,333	88,463,511.72	1.88
16	601318	中国平安	1,642,300	81,474,503.00	1.73
17	300161	华中数控	4,001,423	76,347,150.84	1.62
18	000423	东阿阿胶	999,993	71,889,496.77	1.53
19	600741	华域汽车	2,806,899	68,039,231.76	1.44
20	000700	模塑科技	7,958,376	64,383,261.84	1.37
21	603868	飞科电器	1,001,500	61,932,760.00	1.31
22	000333	美的集团	1,400,000	60,256,000.00	1.28
23	603355	莱克电气	999,936	58,766,238.72	1.25
24	600004	白云机场	2,953,413	54,520,003.98	1.16
25	000002	万科A	2,000,000	49,940,000.00	1.06
26	601888	中国国旅	1,599,756	48,216,645.84	1.02
27	300124	汇川技术	1,718,207	43,883,006.78	0.93
28	600054	黄山旅游	2,373,818	40,592,287.80	0.86
29	002508	老板电器	864,741	37,598,938.68	0.80
30	000404	华意压缩	4,565,881	35,933,483.47	0.76
31	600373	中文传媒	1,418,500	33,348,935.00	0.71

32	002714	牧原股份	1,199,944	32,662,475.68	0.69
33	002241	歌尔股份	1,687,450	32,534,036.00	0.69
34	300282	汇冠股份	1,521,162	32,096,518.20	0.68
35	600258	首旅酒店	1,348,192	31,493,765.12	0.67
36	600703	三安光电	1,499,960	29,549,212.00	0.63
37	000999	华润三九	923,946	29,335,285.50	0.62
38	300308	中际装备	699,900	28,786,887.00	0.61
39	600686	金龙汽车	2,000,000	26,600,000.00	0.56
40	300395	菲利华	1,682,883	24,654,235.95	0.52
41	300415	伊之密	1,659,943	23,969,576.92	0.51
42	000568	泸州老窖	471,522	23,849,582.76	0.51
43	002410	广联达	1,199,938	22,558,834.40	0.48
44	002074	国轩高科	711,300	22,441,515.00	0.48
45	603833	欧派家居	202,179	22,211,384.94	0.47
46	002466	天齐锂业	399,990	21,739,456.50	0.46
47	002376	新北洋	1,500,000	20,580,000.00	0.44
48	600612	老凤祥	400,000	19,588,000.00	0.42
49	002372	伟星新材	1,048,535	19,586,633.80	0.42
50	000661	长春高新	149,957	19,360,948.27	0.41
51	002142	宁波银行	999,932	19,298,687.60	0.41
52	600525	长园集团	1,299,960	17,666,456.40	0.38
53	000786	北新建材	1,094,200	17,332,128.00	0.37
54	601012	隆基股份	999,959	17,099,298.90	0.36
55	600885	宏发股份	416,512	16,614,663.68	0.35
56	600132	重庆啤酒	706,953	16,479,074.43	0.35
57	600900	长江电力	999,984	15,379,753.92	0.33
58	601607	上海医药	500,000	14,440,000.00	0.31
59	002027	分众传媒	1,000,000	13,760,000.00	0.29
60	603737	三棵树	208,476	13,369,565.88	0.28
61	600305	恒顺醋业	1,200,000	12,312,000.00	0.26
62	300059	东方财富	999,944	12,019,326.88	0.26
63	002589	瑞康医药	690,000	10,626,000.00	0.23
64	000049	德赛电池	200,000	10,362,000.00	0.22
65	600298	安琪酵母	400,000	10,348,000.00	0.22
66	002032	苏泊尔	249,379	10,237,007.95	0.22
67	000639	西王食品	500,000	9,895,000.00	0.21
68	300284	苏交科	500,000	9,840,000.00	0.21
69	300083	劲胜精密	1,000,000	9,240,000.00	0.20
70	601169	北京银行	1,000,000	9,170,000.00	0.19
71	002564	天沃科技	999,908	9,129,160.04	0.19
72	601898	中煤能源	1,281,962	7,537,936.56	0.16
73	600116	三峡水利	607,500	6,810,075.00	0.14

74	002048	宁波华翔	300,000	6,258,000.00	0.13
75	600563	法拉电子	99,935	4,937,788.35	0.10
76	000915	山大华特	130,000	4,793,100.00	0.10
77	600335	国机汽车	386,000	4,616,560.00	0.10
78	600486	扬农化工	100,000	4,221,000.00	0.09
79	000059	华锦股份	199,909	2,001,089.09	0.04
80	603660	苏州科达	26,007	1,064,986.65	0.02
81	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.02
82	002521	齐峰新材	78,700	777,556.00	0.02
83	300616	尚品宅配	1,858	251,870.48	0.01
84	603165	荣晟环保	1,767	117,240.45	0.00
85	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.00
86	603517	绝味食品	2,425	84,559.75	0.00
87	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.00
88	002851	麦格米特	1,708	68,097.96	0.00
89	603179	新泉股份	1,495	65,645.45	0.00
90	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.00
91	002869	金溢科技	1,255	54,592.50	0.00
92	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
93	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
94	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
95	300658	延江股份	1,110	43,101.30	0.00
96	603855	华荣股份	2,728	41,792.96	0.00
97	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
98	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.00
99	300622	博士眼镜	1,280	38,950.40	0.00
100	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
101	603787	新日股份	1,849	36,184.93	0.00
102	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
103	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.00
104	300603	立昂技术	1,034	33,894.52	0.00
105	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
106	300643	万通智控	2,027	33,181.99	0.00
107	300652	雷迪克	966	30,863.70	0.00
108	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
109	300514	友讯达	1,024	27,535.36	0.00
110	603139	康惠制药	910	27,181.70	0.00
111	300655	晶瑞股份	873	25,814.61	0.00
112	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
113	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
114	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
115	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00

116	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
117	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
118	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
119	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
120	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
121	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
122	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
123	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600196	复星医药	220,536,253.00	5.50
2	600036	招商银行	143,477,083.61	3.58
3	002841	视源股份	120,779,679.30	3.01
4	600660	福耀玻璃	113,052,441.67	2.82
5	002271	东方雨虹	110,137,363.26	2.75
6	600383	金地集团	105,436,541.65	2.63
7	601600	中国铝业	99,912,897.83	2.49
8	002043	兔宝宝	96,153,118.85	2.40
9	000807	云铝股份	92,980,969.86	2.32
10	601601	中国太保	87,445,676.79	2.18
11	601336	新华保险	87,113,420.32	2.17
12	601628	中国人寿	84,680,083.27	2.11
13	002456	欧菲光	79,957,723.55	2.00
14	000700	模塑科技	71,148,046.01	1.78
15	601318	中国平安	70,114,326.50	1.75
16	000333	美的集团	69,925,487.34	1.75
17	601117	中国化学	65,101,958.94	1.62
18	600741	华域汽车	64,287,389.70	1.60
19	002222	福晶科技	61,939,226.68	1.55
20	002705	新宝股份	59,230,268.99	1.48

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002456	欧菲光	179,296,990.01	4.47
2	002508	老板电器	107,859,129.62	2.69
3	000823	超声电子	99,770,335.50	2.49

4	002415	海康威视	94,900,342.76	2.37
5	000065	北方国际	94,885,892.46	2.37
6	600110	诺德股份	93,998,999.66	2.35
7	000568	泸州老窖	90,870,139.73	2.27
8	601600	中国铝业	87,797,067.31	2.19
9	601628	中国人寿	87,127,832.87	2.17
10	000807	云铝股份	86,538,825.38	2.16
11	600270	外运发展	76,876,871.22	1.92
12	600036	招商银行	74,010,574.00	1.85
13	002241	歌尔股份	73,125,445.39	1.83
14	300340	科恒股份	69,312,149.73	1.73
15	000423	东阿阿胶	69,265,214.47	1.73
16	601117	中国化学	66,579,870.30	1.66
17	000651	格力电器	65,916,585.96	1.65
18	601009	南京银行	64,208,287.33	1.60
19	002222	福晶科技	62,829,172.52	1.57
20	600872	中炬高新	58,096,527.31	1.45

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,107,198,790.05
卖出股票收入（成交）总额	4,067,213,633.98

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	239,812,000.00	5.09
	其中：政策性金融债	239,812,000.00	5.09
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）	17,855,158.40	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	257,667,158.40	5.47

**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	150207	15 国开 07	1,000,000	100,250,000.00	2.13
2	170203	17 国开 03	800,000	79,712,000.00	1.69
3	170408	17 农发 08	600,000	59,850,000.00	1.27
4	127004	模塑转债	90,280	10,433,659.60	0.22
5	132004	15 国盛 EB	58,690	5,494,557.80	0.12

**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	1,140,950.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	28,000.00
4	应收利息	2,718,679.20
5	应收申购款	1,282,853.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,170,483.06



#### 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

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
122,915	37,782.46	169,586,916.40	3.65%	4,474,444,007.10	96.35%

### 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	775,091.38	0.02%

### 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年11月16日) 基金份额总额	12,477,494,128.02
本报告期期初基金份额总额	4,620,537,741.72
本报告期基金总申购份额	359,141,358.65
减：本报告期基金总赎回份额	335,648,176.87
本报告期基金拆分变动份额(份额减少 以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	4,644,030,923.50

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议已于 2017 年 1 月 23 日审议通过了《公司关于聘任公司副总经理、督察长和财务负责人的议案》，秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	551,351,381.50	6.75%	502,447.30	6.70%	-
方正证券	1	583,816,995.03	7.15%	532,031.98	7.09%	-
国泰君安	1	991,369,580.	12.13%	903,435.58	12.04%	-

		11				
华创证券	1	988,364,917.59	12.10%	900,698.03	12.00%	-
华西证券	1	205,361,766.48	2.51%	-	-%	-
南京证券	1	97,343,119.20	1.19%	191,253.80	2.55%	-
平安证券	1	507,097,305.96	6.21%	88,963.78	1.19%	-
瑞银证券	1	1,442,262,658.26	17.65%	462,119.81	6.16%	-
湘财证券	1	312,691,335.77	3.83%	1,335,178.89	17.80%	-
招商证券	1	609,615,187.45	7.46%	284,956.38	3.80%	-
中金公司	1	199,607,348.59	2.44%	555,543.30	7.40%	-
中泰证券	1	171,190,576.56	2.10%	185,894.52	2.48%	-
中信证券	1	1,510,378,187.63	18.49%	159,429.30	2.12%	-
中信证券	1	1,510,378,187.63	18.49%	1,401,068.09	18.67%	-

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

#### A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市

场走向、个股分析报告和专门研究报告；

3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

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

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	9,028,000.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	1,900,000.00	16.54%	-	-	-	-
南京证券	-	-	1,200,000.00	10.44%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	310,000.00	2.70%	-	-	-	-
中金公司	-	-	950,000.00	8.27%	-	-	-	-
中信证券	-	-	7,130,000.00	62.05%	-	-	-	-

### 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金斧子为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-6
2	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-11
3	南方基金关于旗下部分基金增加中原银行为代销机	中国证券报、上海	2017-2-23

	构及开通相关业务的公告	证券报、证券时报	
4	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-2-23
5	南方基金关于旗下部分基金增加萧山农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-3-6
6	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-3-15
7	南方基金关于旗下部分基金增加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	2017-3-22
8	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-4-5
9	南方基金关于旗下部分基金增加大河财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-4-6
10	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-4-23
11	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-6-12

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方绩优成长混合型证券投资基金的文件。
- 2、南方绩优成长混合型证券投资基金基金合同。
- 3、南方绩优成长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>