南方策略优化混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方策略优化混合
基金主代码	202019
前端交易代码	202019
后端交易代码	202020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月30日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	940,541,009.46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“南方策略”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略,在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上,采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置,针对本基金的行业配置策略,基金管理人开发了基于Black-Litterman模型的“南方量化行业配置模型”,在行业配置的基础上,进一步使用“南方多因子量化选股模型”,依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分,精选各行业内具有超额收益能力或潜力的优势个股,构建本基金的股票组合。
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话?		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1? 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	96,124,290.63	302,506,084.69	94,043,056.98
本期利润	25,786,183.23	240,933,392.17	217,210,652.65
加权平均基金份额本期利润	0.0568	0.5914	0.3079
本期基金份额净值增长率	5.37%	62.43%	48.40%
3.1.2? 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.5845	0.3743	-0.1783
期末基金资产净值	1,495,630,752.69	452,965,216.82	684,795,417.97
期末基金份额净值	1.590	1.509	0.929

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)。

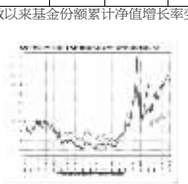
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

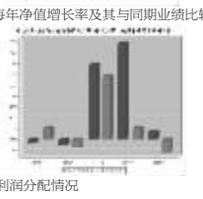
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	2.71%	0.77%	1.43%	0.57%	1.28%	0.20%
过去六个月	12.85%	0.84%	4.28%	0.61%	8.57%	0.23%
过去一年	5.37%	1.68%	-8.16%	1.12%	13.53%	0.56%
过去三年	153.99%	1.83%	38.69%	1.43%	115.30%	0.40%
过去五年	139.82%	1.63%	40.58%	1.30%	99.24%	0.33%
自基金合同生效起至今	62.16%	1.56%	7.49%	1.27%	54.67%	0.29%

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:无。

§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)管理资产规模近6,500亿元,旗下管理116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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
雷俊	本基金基金经理	2015年6月16日	-	8年	北京大学智能科学系硕士,具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金,历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员。现任数量化投资部总监助理;2014年12月至2016年4月,任南方恒生ETF基金经理;2015年4月至2016年4月,任南方中证500工业ETF、南方中证500原材料ETF基金经理;2015年6月至2016年7月,任交革基金、高铁基金、南方500信息基金经理;2015年4月至今,任大数据100基金经理;2015年6月至今,任南方策略优化、大数据300、南方量化成长的基金经理。
杨德龙	本基金基金经理	2013年3月15日	2016年3月4日	10年	北京大学经济学硕士,清华大学工学学士,具有基金从业资格。2006年加入南方基金,担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师;2010年8月至2013年4月,任小康ETF及南方小康基金经理;2011年9月至2016年3月,任南方上证380ETF及联接基金基金经理;2013年3月至2016年3月,任南方策略基金经理;2013年4月至2016年3月,任南方300基金经理;2013年4月至2016年3月、任南方开元沪深300ETF基金经理;2014年12月至2016年3月,任南方恒生ETF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《南方策略优化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,没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度A股略有回升,整体上看是先涨后跌,下跌时大盘略优于小盘股,市场总体仍在一个较窄的区间内震荡。

报告期内本基金采用量化多因子模型选股,重点集中在具有相对优势的价值和成长股之间进行投资。本基金充分发挥量化选股的优势,运用多个量化策略投资,分散投资风险和平衡风险暴露,行业涨跌波动剧烈时在同类基金产品中表现稳健,后续产品运作仍将以量化策略为主,力争获取超越市场表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.590元,报告期内,份额净值增长率为5.37%,同期业绩基准增长率为-8.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观上看,国内经济阶段企稳、通胀压力有所回升,货币政策将更加中性,无风险利率的回升将对冲掉部分企业盈利改善的利好,人民币汇率转强又有助于修复风险偏好,对冲险资举牌监管的影响;从估值、盈利和跨境比较角度看,权益类资产经历三轮大幅下跌后,投资性价比已经大幅提高,部分板块和个股的投资价值凸显。增量资金依然可期,只是以低风险偏好的机构资金为主,人市节奏较为缓慢;综合以上,权益市场的慢牛表现逻辑逐渐加强。

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:本基金收益分配应遵循下列原则:每一基金份额享有同等分配权;若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;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,基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年最多12次,每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的10%;基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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。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策略优化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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本基金2016年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2017)第21463号“标准无保留意见的审计报告”,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:南方策略优化混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资?产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资?产:		
银行存款	135,093,667.58	50,937,223.20
结算备付金	7,223,244.41	1,268,641.46
存出保证金	313,302.15	174,806.74
交易性金融资产	1,359,791,002.84	400,981,001.22
其中:股票投资	1,359,791,002.84	400,981,001.22
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	50,000,000.00	-
应收证券清算款	-	1,656,947.62
应收利息	27,060.15	10,949.21
应收股利	-	-
应收申购款	3,199,039.69	4,176,860.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,555,647,316.82	459,206,430.34
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负?债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	50,000,000.00	-
应付赎回款	4,720,940.07	1,798,295.30
应付管理人报酬	1,881,203.72	537,210.43
应付托管费	313,533.96	89,535.08
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,726,995.07	3,458,858.14
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	373,891.31	357,314.57
负债合计	60,016,564.13	6,241,213.52
所有者权益:		
实收基金	940,541,009.46	300,223,083.71
未分配利润	555,089,743.23	152,742,133.11
所有者权益合计	1,495,630,752.69	452,965,216.82
负债和所有者权益总计	1,555,647,316.82	459,206,430.34

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.590元,基金份额总额940,541,009.46份。

7.2 利润表

会计主体:南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项?目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	46,251,479.01	258,273,086.17
1.利息收入	649,307.42	642,651.10
其中:存款利息收入	517,842.53	370,996.99
债券利息收入	0.88	1,022.52
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	131,464.01	270,631.59
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	115,459,504.43	318,518,080.43
其中:股票投资收益	111,980,476.58	315,176,274.43
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,990.32	418,087.15
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,477,037.53	2,923,718.85
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-70,338,107.40	-61,572,692.52
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	490,774.56	685,047.16
减:二、费用	20,465,295.78	17,339,694.00
1. 管理人报酬	9,848,289.21	7,450,007.97
2. 托管费	1,641,381.44	1,241,668.09
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,599,273.06	8,268,082.73
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	376,352.07	379,935.21
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	25,786,183.23	240,933,392.17
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	25,786,183.23	240,933,392.17

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	300,223,083.71	152,742,133.11	452,965,216.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,786,183.23	25,786,183.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	640,317,925.75	376,561,426.89	1,016,879,352.64
其中:1.基金申购款	924,317,325.34	522,321,527.69	1,446,638,853.03
2.基金赎回款	-283,999,399.59	-145,760,100.80	-429,759,500.39
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)	940,541,009.46	555,089,743.23	1,495,630,752.69
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	737,168,481.26	-52,373,063.29	684,795,417.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	240,933,392.17	240,933,392.17
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)	-436,945,397.55	-35,818,195.77	-472,763,593.32
其中:1.基金申购款	393,301,563.58	164,739,469.58	558,041,033.16
2.基金赎回款	-830,246,961.13	-200,557,665.35	-1,030,804,626.48
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)	300,223,083.71	152,742,133.11	452,965,216.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____杨小松_____ _____徐超_____ _____徐超_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.3 关联方关系

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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	3,289,857,584.02	54.79%	566,990,218.34	10.65%

7.4.4.1.2 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	3,018,399.40	54.68%	2,601,110.22	95.38%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	501,737.29	10.47%	1,272,500.16	36.79%

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

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

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,848,289.21	7,450,007.97
其中:支付销售机构的客户维护费	2,289,248.82	2,110,799.23

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,641,381.44	1,241,668.09

注:支付基金托管人招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:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

注:本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	135,093,667.58	465,871.46	50,937,223.20	319,127.91

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

注:本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.5 利润分配情况

注:本基金本报告期内无利润分配。

7.4.6 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.6.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300683	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002652	扬子新材	2016年12月12日	重大资产重组	18.11	-	-	500,300	8,224,396.92	9,060,433.00	-
600892	大晟文化	2016年11月16日	重大资产重组	78.31	2017年2月21日	70.48	83,010	5,561,036.92	6,500,513.10	-
300213	佳讯飞鸿	2016年11月4日	重大资产重组	28.00	2017年2月17日	25.48	174,100	5,004,187.42	4,874,800.00	-
300150	世纪瑞尔	2016年11月8日	重大资产重组	9.97	2017年3月21日	10.97	471,200	4,882,588.83	4,697,864.00	-
002578	闽发铝业	2016年10月12日	重大资产重组	11.89	-	-	388,000	3,622,003.80	4,613,320.00	-
600887	伊利股份	2016年11月18日	重大资产重组	25.94	2017年2月15日	23.99	152,700	3,950,781.03	3,961,038.00	-
000560	昆百大A	2016年9月2日	重大资产重组	10.40	2017年3月24日	11.44	327,200	3,296,706.80	3,402,880.00	-
600189	吉林森工	2016年7月8日	重大资产重组	12.05	2017年1月4日	13.26	275,900	2,954,014.96	3,324,595.00	-
002132	恒星科技	2016年12月20日	重大事项	6.58	-	-	350,300	2,335,694.68	2,304,974.00	-
000411	英特集团	2016年12月27日	重大事项	22.10	2017年1月11日	24.31	86,800	1,943,367.84	1,918,280.00	-
600649	城投控股	2016年12月6日	重大资产重组	20.34	-	-	61,000	1,144,125.00	1,240,740.00	-
002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项	13.79	-	-	36,400	479,987.00	501,956.00	-
600814	杭州解百	2016年12月26日	重大事项未公告	11.37	2017年1月9日	10.70	41,900	464,857.00	476,403.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项未公告	14.60	-	-	30,800	519,910.00	449,680.00	-
002235	科华恒盛	2016年12月16日	重大资产重组	42.90	2017年3月27日	43.10	10,400	460,139.57	446,160.00	-
002462	嘉事堂	2016年9月28日	重大资产重组	42.53	2017年1月12日	38.98	7,800	296,820.05	331,734.00	-
002567	唐人神	2016年12月22日	重大事项	12.64	2017年1月3日	12.75	24,900	338,085.16	314,736.00	-
600239	云南城投	2016年12月30日	重大事项未公告	5.66	2017年1月3日	5.70	52,100	253,063.29	294,886.00	-
300065	海兰信	2016年12月8日	重大资产重组	38.52	-	-	7,300	273,296.00	281,196.00	-
300498	温氏股份	2016年11月17日	重大资产重组