

# 南方天元新产业股票型证券投资基金(原天元证券投资基金)2014年年度报告摘要

2014年12月31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：2015年3月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 20 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。

天元证券投资基金份额持有人大会已于 2014 年 5 月 8 日审议通过了《关于天元证券投资基金转型有关事项的议案》，同意将天元证券投资基金转型为南方天元新产业股票型证券投资基金。基金管理人已收到中国证券监督管理委员会《关于天元证券投资基金份额持有人大会决议备案的回函》（证券基金机构监管部部函[2014]341 号），《南方天元新产业股票型证券投资基金基金合同》自 2014 年 7 月 3 日起生效。

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。

原天元证券投资基金本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 7 月 2 日止，南方天元新产业股票型证券投资基金本报告期自 2014 年 7 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	南方天元封闭
基金主代码	184698
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 8 月 25 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	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期（若有）	1999 年 8 月 25 日- 2014 年 7 月 2 日

注：原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“基金天元”。

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	南方天元新产业股票
基金主代码	160133
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2014 年 7 月 3 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	757,850,883.97 份
基金合同存续期（若有）	不定期

注：1. 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“南方天元”。

2. 本基金转型日期为 2014 年 7 月 3 日，该日起原天元证券投资基金正式变更为南方天元新产业股票型证券投资基金。

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金属于成长收入型基金，主要投资于两个市场股票中的指标股。本基金所称指标股是按照行业代表性、流通性、资本增值潜力、分红状况的标准从两市股票中挑选出来的绩优成长型上市公司。本基金的投资目标是在减少和分散投资风险的前提下，以稳健的投资原则，确保基金资产安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	根据契约要求，本基金通过深入的研究，选取具有行业代表性、股票流通性较好、资本增值潜力较大、分红稳定等特征的指标型上市公司，进行中长期投资。以稳健的投资原则，力求确保基金资产安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金为股票型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，采用自上而下和自下而上结合选股的模式，在我国经济转型的背景下，寻找传统行业中的新型企业和新兴产业中的优势企业，兼顾上市公司的安全边际，争取基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准（若有）	80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征（若有）	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

## 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	蒋松云
	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

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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	2014 年 1 月 1 日-2014 年 12 月 31 日		2013 年	2012 年
	转型前（2014 年 1 月 1 日-2014 年 7 月 2 日）	转型后（2014 年 7 月 3 日-2014 年 12 月 31 日）		
本期已实现收益	60,124,381.49	154,682,155.56	192,798,113.00	-256,314,146.37
本期利润	-75,215,227.97	337,821,073.62	233,166,363.78	92,648,114.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0251	0.1960	0.0777	0.0309
本期基金份额净值增长率	-2.68%	29.55%	9.05%	3.72%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末		2013 年末	2012 年末
	2014 年 7 月 2 日	2014 年 12 月 31 日		
期末可供分配基金份额利润	-0.0888	0.0656	-0.1088	-0.1731
期末基金资产净值	2,736,883,647.82	957,368,738.70	2,812,098,875.79	2,578,932,512.01
期末基金份额净值	0.9123	1.263	0.9374	0.8596

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. 本基金已于 2014 年 7 月 31 日对原天元证券投资基金退市时基金份额进行了折算，基金折算比例为 1:0.935496017。

5. 本基金转型日期为 2014 年 7 月 3 日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

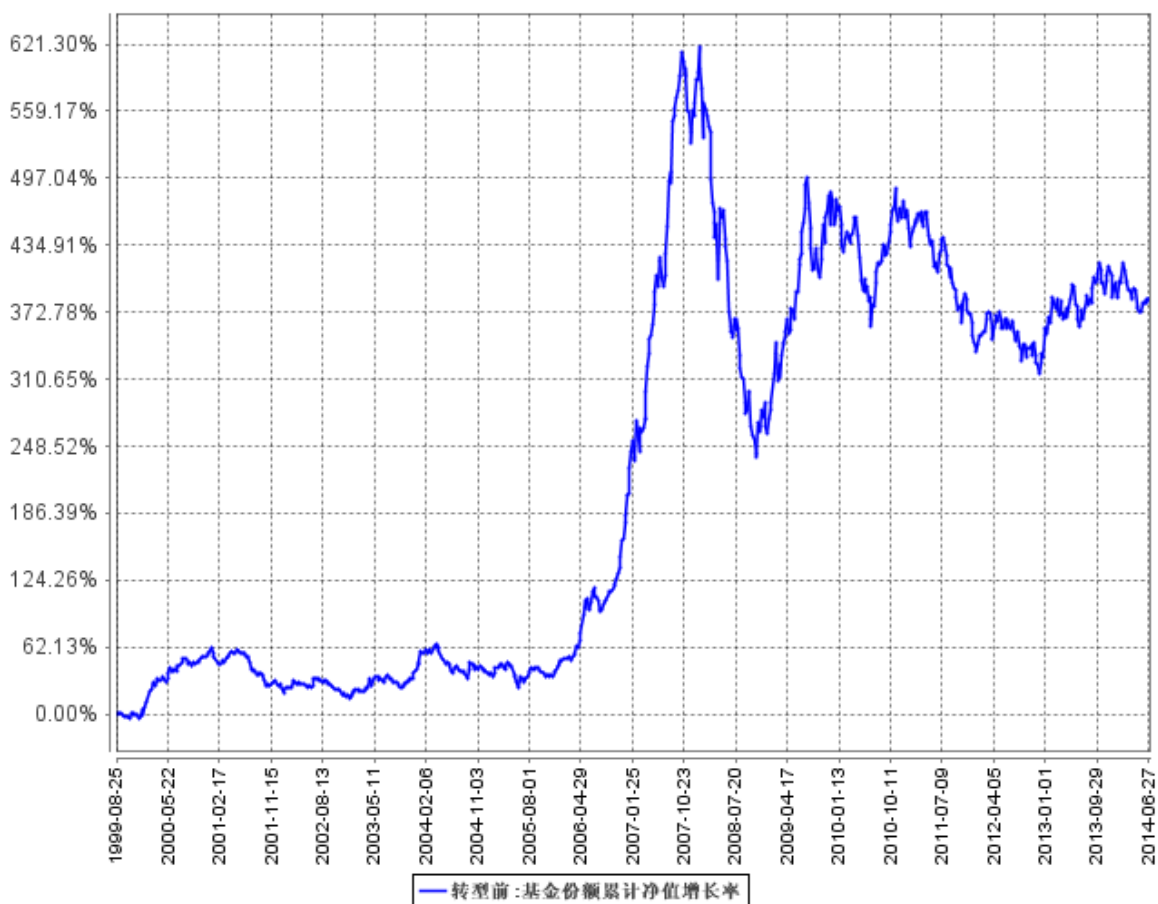
### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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（转型前）

转型前						
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	-0.26%	0.71%	0.00%	0.00%	-0.26%	0.71%
过去六个月	-1.89%	1.24%	0.00%	0.00%	-1.89%	1.24%
过去一年	3.11%	1.53%	0.00%	0.00%	3.11%	1.53%
过去三年	-8.30%	1.72%	0.00%	0.00%	-8.30%	1.72%
过去五年	-9.27%	1.99%	0.00%	0.00%	-9.27%	1.99%
自基金合同生效起至今	382.81%	2.50%	0.00%	0.00%	382.81%	2.50%

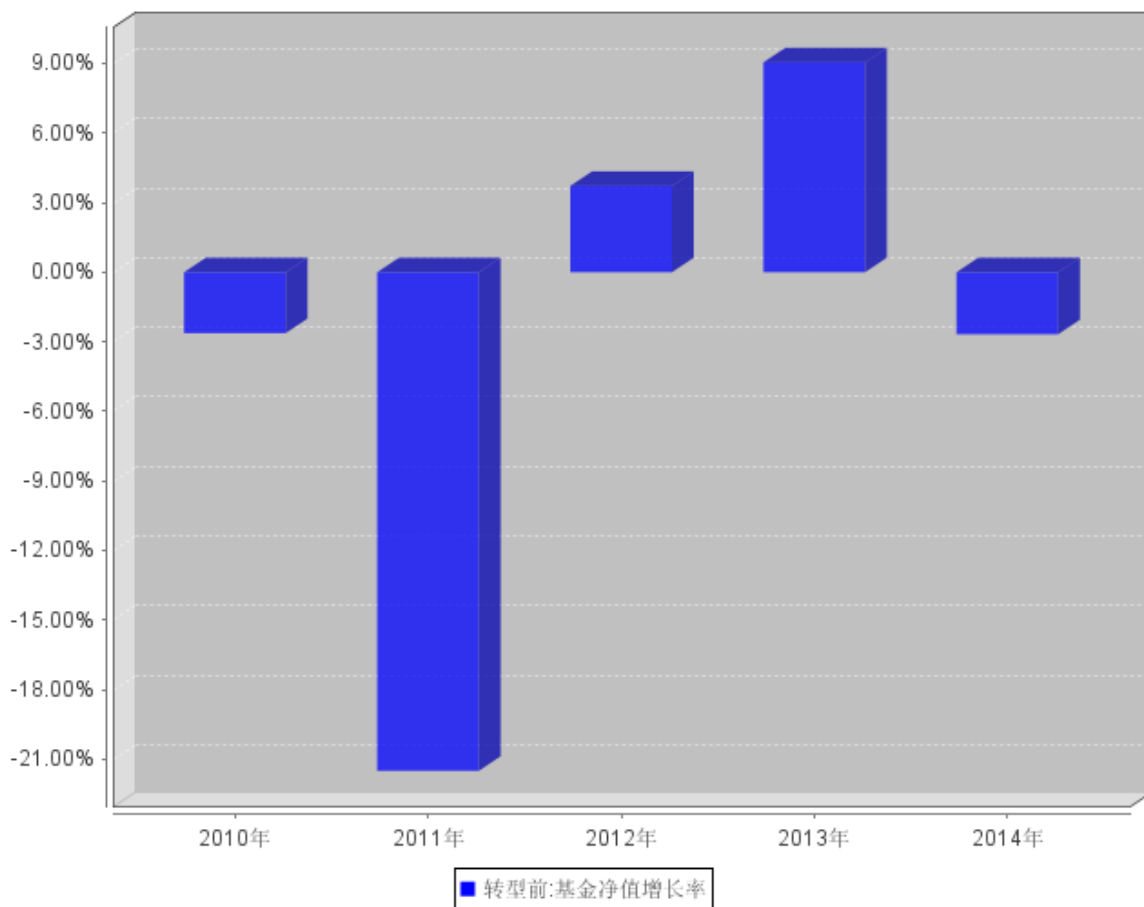
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



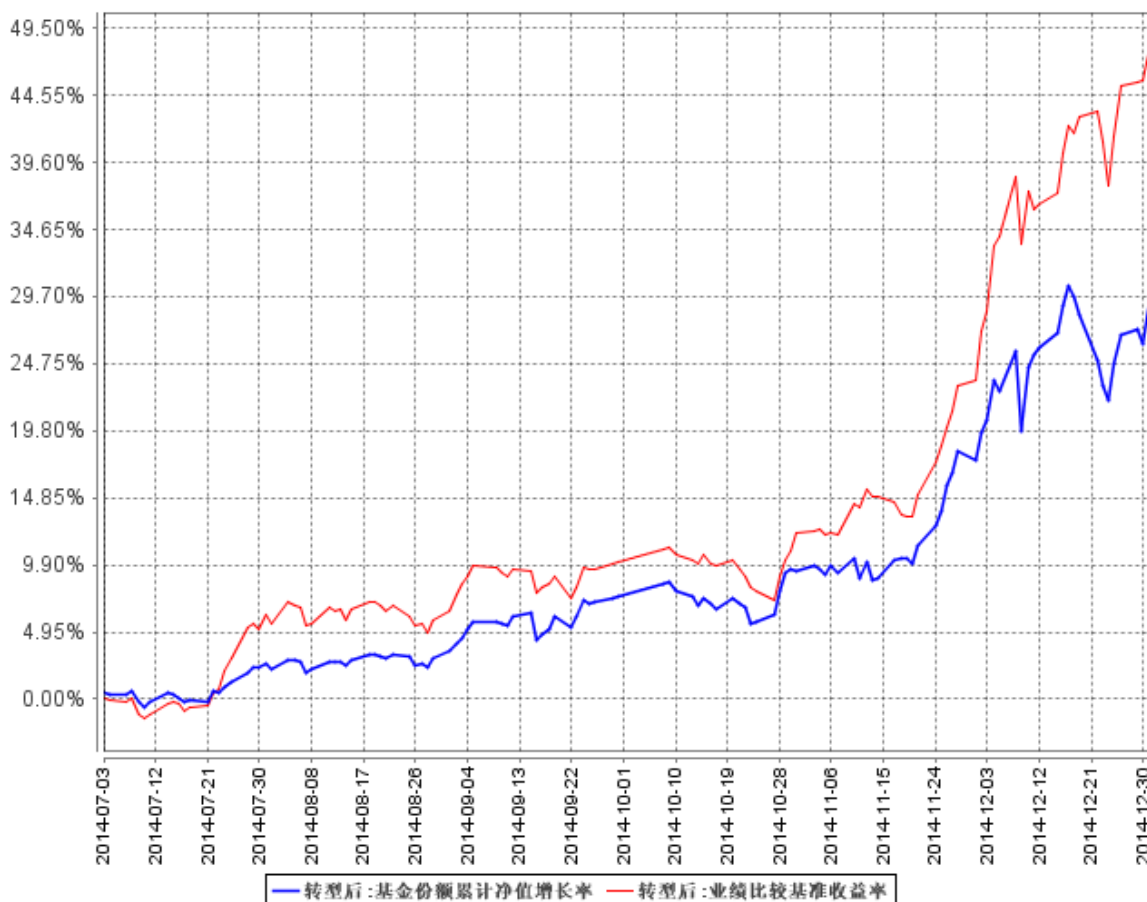
## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 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（转型后）

转型后						
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	20.40%	1.32%	34.58%	1.32%	-14.18%	0.00%
自基金合同生效起至今	29.55%	1.17%	48.18%	1.07%	-18.63%	0.10%

### 3.2.2 自基金转型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



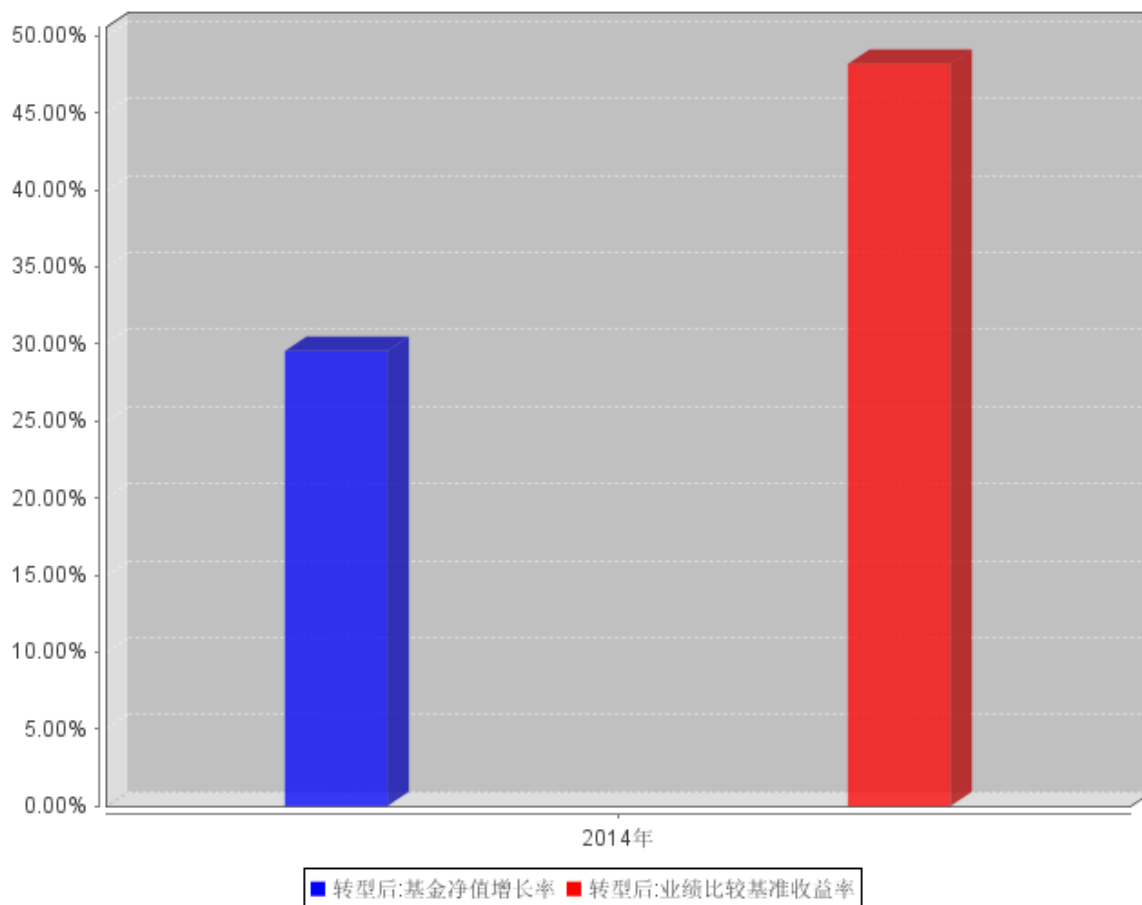
注:1、本基金转型日期为 2014 年 7 月 3 日,截止报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、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末结束。



### 3.2.3 自基金转型以来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

基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

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 3,000 亿元，旗下管理 57 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（转型前）

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		
陈键	本基金基金经理、投资部总监	2006 年 3 月 16 日	2014 年 7 月 2 日	14 年	硕士学历，具有基金从业资格。2000 年加入南方基金，历任行业研究员、基金经理助理，2009 年 12 月至今，担任投资部执行总监，主持工作。2003 年 11 月-2005 年 6 月，任南方宝元基金经理；2004 年 3 月-2005 年 3 月，任南方现金基金经理；2005 年 3 月-2006 年 3 月，任南方积配基金经理；2008 年 2 月至 2010 年 10 月，任南方盛元基金经理；2006 年 3 月至 2014 年 7 月，任天元基金经理；2010 年 10 月至今，任南方成份基金经理；2012 年 12 月至今，任南方安心基金经理。

注：1.1. 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。

**基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）**

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		
蒋朋 宸	本基金 基金经 理	2014 年 7 月 3 日	-	10 年	北大生物化学硕士、美国哥伦比亚大学金融工 程学硕士，具有基金从业资格。曾担任鹏华基 金公司基金管理部分析师，2005 年加入南方基 金，2008 年 4 月至 2010 年 12 月，任南方盛元 基金经理；2008 年 4 月至 2014 年 1 月，任南 方隆元基金经理；2010 年 12 月至 2014 年 7 月， 任基金天元基金经理；2009 年 2 月至今，任南 方宝元债券基金经理；2014 年 7 月至今，任南 方天元基金经理。

注：1.1. 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**

本基金由基金天元于 2014 年 7 月 3 日正式转型而来。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《天元证券投资基金合同》《南方天元新产业股票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 公平交易制度和控制方法**

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投

资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为7次，其中6次是由于指数型基金根据标的指数成份股调整而被动调仓所致，1次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

### 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

2014年以来，世界各国经济持续缓慢复苏，美国股市持续走高，唯独目前美联储加息的可能性和油价的大幅度下跌让市场担心。国内经济方面，我们维持中国经济增速温和走缓的预测。股票方面，受到央行降息的影响，大盘蓝筹股活跃，我们也参与了部分大盘股的投资。2014年中国证券市场表现非常靓丽，尤其四季度以来大盘指数持续走高，我们看好那些有成长、低估值的股票并且进行了适量的投资，获得了较好效果。我们在“封转开”过程中以较高仓位给投资者获得了不错的绝对回报。由于2014年本基金处于“封转开”期间，因而股票部分仓位偏轻，没有完全跟上大盘的涨幅。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末，本基金份额净值为1.263元，本报告期（2014年7月3日—2014年12月31日）份额净值增长率为29.55%。

截至转型前报告期末，本基金份额净值为0.9123元，本报告期（2014年1月1日—2014年7月2日）份额净值增长率为-2.68%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

因中国经济体量已经足够大，我们预计 2015 年在经济偏弱的大前提下，仍会有不少公司能获得较好的成长。中国股市的政策市特点使得其下跌空间有限。我们认为 2015 年 A 股市场机会仍然很多，我们将秉承一贯风格，寻找其中有价值的股票进行合理操作，以求给投资者带来长期稳定的收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司内控自查、基金从业人员证券投资行为自查等多项内控自查工作，制定或修订了关联交易管理、员工证券投资管理 etc 内部制度，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金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、权益投资总监、数量化投资

部总监、风险管理部总监及基金会计负责人等。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金由基金天元于 2014 年 7 月 3 日正式转型而来。

##### （1）基金天元基金合同关于收益分配的表述

基金天元合同约定，基金天元的收益分配原则为：基金收益分配采取现金方式，每年至少一次；基金年度收益分配比例不得低于基金年度已实现收益的 90%；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；基金投资当年亏损，则不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权。

##### （2）本基金合同关于收益分配的表述

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该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；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，本报告期本基金不符合基金合同约定的收益分配条件，未有收益分配事项。

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

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方天元新产业股票型投资基金(原天元证券投资基金)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，南方天元新产业股票型投资基金(原天元证券投资基金)的管理人——南方基金管理有限公司在南方天元新产业股票型投资基金(原天元证券投资基金)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，南方天元新产业股票型投资基金(原天元证券投资基金)未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方天元新产业股票型投资基金(原天元证券投资基金)2014 年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 审计报告(转型前)

本基金 2014 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(2015)第 20344 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。

## §6 审计报告（转型后）

本基金 2014 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(2015)第 20398 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(转型前)

### 7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：天元证券投资基金

报告截止日：2014 年 7 月 2 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 7 月 2 日 (基金合同失效前日)	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	285,006,959.90	211,771,844.47
结算备付金		1,140,482.93	2,071,150.60
存出保证金		675,483.31	779,787.40
交易性金融资产	7.4.7.2	2,440,662,461.67	2,495,164,489.50
其中：股票投资		1,096,129,998.47	1,872,665,669.50
基金投资		-	-
债券投资		1,344,532,463.20	622,498,820.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	95,575,401.01
应收利息	7.4.7.5	34,953,057.11	12,959,022.91
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,762,438,444.92	2,818,321,695.89
<b>负债和所有者权益</b>			
	附注号	本期末 2014 年 7 月 2 日 (基金合同失效前日)	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		19,800,805.52	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,575,343.88	3,597,044.31
应付托管费		595,890.65	599,507.38
应付销售服务费		-	-



应付交易费用	7.4.7.7	601,541.18	1,075,268.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	981,215.87	951,000.00
负债合计		25,554,797.10	6,222,820.10
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-263,116,352.18	-187,901,124.21
所有者权益合计		2,736,883,647.82	2,812,098,875.79
负债和所有者权益总计		2,762,438,444.92	2,818,321,695.89

注：

1. 报告截止日 2014 年 7 月 2 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 0.9123 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 2 日(基金合同失效前日)。

## 7.2 利润表

会计主体：天元证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 2 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 2 日(基金 合同失效前日)	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-46,969,621.74	291,152,470.36
1. 利息收入		24,491,446.60	23,118,735.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,244,807.02	1,961,721.67
债券利息收入		23,225,793.85	19,536,388.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,845.73	1,620,625.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		63,878,541.12	227,559,653.21
其中：股票投资收益	7.4.7.12	51,023,313.56	194,695,698.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,163,210.00	2,281,509.93
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	11,692,017.56	30,582,444.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-135,339,609.46	40,368,250.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	105,830.59
<b>减：二、费用</b>		28,245,606.23	57,986,106.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	20,738,565.75	40,978,509.37
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,460,163.32	6,829,751.57
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,733,607.47	9,700,881.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	313,269.69	476,964.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-75,215,227.97	233,166,363.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-75,215,227.97	233,166,363.78

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天元证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 2 日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 7 月 2 日（基金合同失效前日）		
	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）	3,000,000,000.00	-187,901,124.21	2,812,098,875.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-75,215,227.97	-75,215,227.97
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-

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）	3,000,000,000.00	-263,116,352.18	2,736,883,647.82
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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）	3,000,000,000.00	-421,067,487.99	2,578,932,512.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	233,166,363.78	233,166,363.78
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	3,000,000,000.00	-187,901,124.21	2,812,098,875.79

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准

则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

#### 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[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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、基金发起人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东
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 2014年1月1日至2014年7月2日 (基金合同失效前日)		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
兴业证券	228,553,487.36	10.26%	370,969,725.78	5.89%

##### 7.4.4.1.2 权证交易

注：无。

##### 7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年7月2日(基金合同失效前日)			
	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	202,247.90	10.11%	202,247.90	33.75%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
兴业证券	328,053.38	5.78%	126,540.81	11.78%

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。权证交易不计佣金。
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 2014年1月1日至2014年 7月2日(基金合同失效前日)	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,738,565.75	40,978,509.37
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	-	-

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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 7月2日(基金合同失效前日)	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,460,163.32	6,829,751.57

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：

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：无。

**7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年7月2日(基金合同失效前日)	2013年1月1日至2013年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	44,335,529.00	44,335,529.00
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	44,335,529.00	44,335,529.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.48%	1.48%

**7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：无。

**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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年7月2日(基金合同失效前日)		2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	285,006,959.90	1,218,775.80	211,771,844.47	1,889,998.91

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。

**7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

无。

### 7.4.5 利润分配情况

注：无。

### 7.4.6 期末（2014 年 7 月 2 日(基金合同失效前日)）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

7.4.12.1.1 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	说明
603369	今世缘	2014 年 6 月 25 日	2014 年 7 月 3 日	新股流通受限	16.93	16.93	5,105	86,427.65	86,427.65	-

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股票

无。

#### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

## §7 年度财务报表(转型后)

### 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：南方天元新产业股票型证券投资基金(原天元证券投资基金)

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	161,445,863.79
结算备付金		1,105,963.72
存出保证金		505,918.64



交易性金融资产	7.4.7.2	864,511,764.66
其中：股票投资		861,628,764.66
基金投资		-
债券投资		2,883,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	28,665.59
应收股利		-
应收申购款		3,955.51
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,027,602,131.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		56,668,969.73
应付赎回款		9,829,545.49
应付管理人报酬		1,209,200.75
应付托管费		201,533.48
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	1,195,803.81
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	1,128,339.95
负债合计		70,233,393.21
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	810,201,124.39
未分配利润	7.4.7.10	147,167,614.31
所有者权益合计		957,368,738.70
负债和所有者权益总计		1,027,602,131.91

注：

1. 报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.263 元，基金份额总额 757,850,883.97 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：南方天元新产业股票型证券投资基金(原天元证券投资基金)

本报告期：2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 7 月 3 日 (基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		357,343,117.74
1. 利息收入		10,878,553.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,302,526.96
债券利息收入		9,125,357.12
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		450,669.19
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		152,962,693.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	137,225,584.78
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	5,018,795.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	183,138,918.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	10,362,953.37
<b>减：二、费用</b>		19,522,044.12
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,894,492.06
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,149,082.03
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,168,253.43
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	310,216.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		337,821,073.62
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		337,821,073.62
-------------------	--	----------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方天元新产业股票型证券投资基金(原天元证券投资基金)

本报告期：2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日) 至 2014 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）	3,000,000,000.00	-263,116,352.18	2,736,883,647.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	337,821,073.62	337,821,073.62
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）	-2,189,798,875.61	72,462,892.87	-2,117,335,982.74
其中：1. 基金申购款	13,209,558.37	180,150.01	13,389,708.38
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-2,203,008,433.98	72,282,742.86	-2,130,725,691.12
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）	810,201,124.39	147,167,614.31	957,368,738.70

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 基金基本情况

南方天元新产业股票型证券投资基金是根据原天元证券投资基金(以下简称“基金天元”)基金份额持有人大会 2014 年 5 月 8 日决议通过的《关于天元证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)基金监管部签发的基金部函

[2014]341 号《关于天元证券投资基金份额持有人大会决议备案的回函》核准，由原基金基金天元转型而来。原基金基金天元为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限为 15 年期，至 2014 年 8 月 25 日止。根据深交所深证上[2014]216 号《终止上市通知书》，原基金基金天元于 2014 年 7 月 2 日提前终止上市权利登记。自 2014 年 7 月 3 日起，原基金基金天元终止上市，并更名为南方天元新产业股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）。原《天元证券投资基金基金合同》失效，《南方天元新产业股票型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型上市开放式基金，存续期间不定。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金基金天元于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 2,736,883,647.82 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《南方天元新产业股票型证券投资基金招募说明书》和《关于南方天元新产业股票型证券投资基金集中申购结果和原基金天元份额折算结果的公告》的有关规定，本基金以 2014 年 7 月 31 日为基金份额折算基准日对投资人持有的原基金基金天元份额进行了折算，折算比例为 0.935496017，并由中国证券登记结算有限责任公司完成了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2014 年 7 月 17 日至 2014 年 7 月 25 日期间内开放集中申购，共募集 4,943,575.44 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 1,040.75 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2014）第 434 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2014 年 7 月 31 日基金份额折算后的基金份额净值 1.0000 元折合为 4,943,575.44 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 1,040.75 份基金份额，并于 2014 年 7 月 31 日进行了确认登记。

经深交所深证上字[2014]299 号文审核同意，本基金 2,284,229,153.00 份基金份额于 2014 年 8 月 25 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方天元新产业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、

政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%，债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2015 年 3 月 24 日批准报出。

## 7.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方天元新产业股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 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 2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 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。

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 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）。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

#### **7.4.4.11 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，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。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。

#### **7.4.4.12 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，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 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)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。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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》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，暂减按 25%计入应纳税所得额。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。

#### 7.4.7 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、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	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。

#### 7.4.8 本报告期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	12,894,492.06
其中：支付销售机构的 客户维护费	434,413.01

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。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	2,149,082.03

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期
	2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	44,335,529.00
报告期初持有的基金份额	44,335,529.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-2,859,818.00

减：报告期内赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	41,475,711.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.47%

#### 7.4.8.4.2 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

无。

#### 7.4.8.5 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 2014 年 7 月 3 日(基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	161,445,863.79	1,280,038.84

注：本基金的活期存款由基金托管人 中国工商银行 保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.10 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额
110030	格力转债	2014 年 12 月 25 日	2015 年 1 月 13 日	新债认购	100.00	100.00	28,830	2,883,000.00	2,883,000.00

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/新债申购。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/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票

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
600240	华业地产	2014年10月16日	重大资产重组	9.99	2015年1月22日	7.91	4,781,812	22,528,289.38	47,770,301.88	-
600332	白云山	2014年12月3日	公告重大事项	27.11	2015年1月13日	29.82	100,000	2,597,235.53	2,711,000.00	-
600584	长电科技	2014年11月3日	重大资产重组	11.13	2015年1月14日	12.24	500,000	4,678,023.00	5,565,000.00	-
002331	皖通科技	2014年11月10日	重大资产重组	15.42	-	-	543,704	6,877,212.02	8,383,915.68	-
002675	东诚药业	2014年10月10日	公告重大事项	24.18	-	-	34,995	694,957.85	846,179.10	-
300126	锐奇股份	2014年12月10日	重大事项未公告	12.14	-	-	55	634.83	667.70	-
300244	迪安诊断	2014年10月13日	公告重大事项	43.93	2015年1月9日	44.00	100,000	4,340,454.88	4,393,000.00	-

注：本基金截至2014年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

## §8 投资组合报告(转型前)

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,096,129,998.47	39.68
	其中：股票	1,096,129,998.47	39.68
2	固定收益投资	1,344,532,463.20	48.67
	其中：债券	1,344,532,463.20	48.67
	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	286,147,442.83	10.36
7	其他资产	35,628,540.42	1.29
8	合计	2,762,438,444.92	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,649,221.50	0.32
B	采矿业	142,054,251.08	5.19
C	制造业	475,517,971.27	17.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	165,565,313.33	6.05
G	交通运输、仓储和邮政业	7,143,597.40	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,532,928.49	2.25
J	金融业	175,312,610.53	6.41
K	房地产业	48,215,345.71	1.76

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,138,759.16	0.44
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,096,129,998.47	40.05

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601607	上海医药	8,393,082	103,990,285.98	3.80
2	600583	海油工程	13,039,395	96,361,129.05	3.52
3	601318	中国平安	1,499,905	59,156,253.20	2.16
4	002557	洽洽食品	3,108,520	52,844,840.00	1.93
5	002594	比亚迪	1,069,210	51,215,159.00	1.87
6	600511	国药股份	2,044,484	45,939,555.48	1.68
7	002331	皖通科技	3,615,464	40,746,279.28	1.49
8	601601	中国太保	1,999,961	35,519,307.36	1.30
9	600240	华业地产	7,111,456	33,779,416.00	1.23
10	002241	歌尔声学	1,107,919	30,024,604.90	1.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002557	洽洽食品	65,260,648.86	2.32
2	002242	九阳股份	63,439,899.02	2.26
3	002405	四维图新	59,514,068.59	2.12



4	002331	皖通科技	45,731,340.04	1.63
5	601318	中国平安	41,494,618.38	1.48
6	600240	华业地产	33,031,058.95	1.17
7	300098	高新兴	23,252,298.99	0.83
8	002327	富安娜	22,584,241.48	0.80
9	300030	阳普医疗	21,822,297.00	0.78
10	600028	中国石化	21,236,102.73	0.76
11	002433	太安堂	18,555,696.37	0.66
12	601601	中国太保	17,998,811.05	0.64
13	002303	美盈森	16,137,110.62	0.57
14	601088	中国神华	15,330,946.18	0.55
15	601628	中国人寿	15,077,390.83	0.54
16	600446	金证股份	13,961,197.70	0.50
17	300295	三六五网	12,874,035.41	0.46
18	600600	青岛啤酒	12,620,735.11	0.45
19	300155	安居宝	11,293,151.88	0.40
20	002396	星网锐捷	10,912,355.23	0.39

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002570	贝因美	73,648,395.41	2.62
2	002405	四维图新	71,724,847.19	2.55
3	002185	华天科技	63,445,933.18	2.26
4	600036	招商银行	52,378,483.32	1.86
5	600518	康美药业	48,811,851.92	1.74
6	600030	中信证券	46,832,536.71	1.67
7	600875	东方电气	45,735,850.12	1.63
8	300177	中海达	43,165,083.45	1.53
9	600703	三安光电	42,908,855.13	1.53
10	600240	华业地产	41,379,596.93	1.47
11	601318	中国平安	40,348,598.82	1.43
12	600872	中炬高新	39,678,427.71	1.41
13	002396	星网锐捷	39,430,604.04	1.40

14	601299	中国北车	38,603,490.99	1.37
15	002242	九阳股份	36,101,135.45	1.28
16	002429	兆驰股份	32,693,376.60	1.16
17	601800	中国交建	30,464,347.29	1.08
18	601668	中国建筑	29,858,986.00	1.06
19	002594	比亚迪	28,400,227.77	1.01
20	601028	玉龙股份	25,806,401.43	0.92

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	781,534,569.38
卖出股票收入（成交）总额	1,462,859,401.31

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,308,447,000.00	47.81
	其中：政策性金融债	1,308,447,000.00	47.81
4	企业债券	30,327,000.00	1.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,758,463.20	0.21
8	其他	-	-
9	合计	1,344,532,463.20	49.13

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130428	13 农发 28	2,500,000	250,450,000.00	9.15
2	140208	14 国开 08	2,000,000	203,060,000.00	7.42

3	120204	12 国开 04	2,000,000	199,100,000.00	7.27
4	130236	13 国开 36	1,800,000	180,036,000.00	6.58
5	130227	13 国开 27	1,600,000	160,016,000.00	5.85

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

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

#### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	675,483.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,953,057.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,628,540.42

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113005	平安转债	5,758,463.20	0.21

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§8 投资组合报告(转型后)****8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	861,628,764.66	83.85
	其中：股票	861,628,764.66	83.85
2	固定收益投资	2,883,000.00	0.28
	其中：债券	2,883,000.00	0.28
	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	162,551,827.51	15.82
7	其他资产	538,539.74	0.05
8	合计	1,027,602,131.91	100.00

**8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,726.86	0.00
B	采矿业	12,980,000.00	1.36
C	制造业	300,168,137.07	31.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	53,858,104.19	5.63
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,686,511.83	3.00
J	金融业	192,596,034.82	20.12
K	房地产业	226,669,654.14	23.68
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,419,595.75	3.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,393,000.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	11,856,000.00	1.24
	合计	861,628,764.66	90.00

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细(转型后)

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	600036	招商银行	3,076,786	51,043,879.74	5.33
2	600240	华业地产	4,781,812	47,770,301.88	4.99
3	600000	浦发银行	2,863,470	44,927,844.30	4.69
4	000718	苏宁环球	6,258,911	42,122,471.03	4.40
5	601607	上海医药	2,324,626	38,356,329.00	4.01
6	600185	格力地产	1,699,969	37,399,318.00	3.91

7	000709	河北钢铁	8,000,000	30,640,000.00	3.20
8	601318	中国平安	400,059	29,888,407.89	3.12
9	000625	长安汽车	1,614,940	26,533,464.20	2.77
10	002658	雪迪龙	961,241	26,472,577.14	2.77

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	002230	科大讯飞	62,823,187.96	6.56
2	600690	青岛海尔	61,642,779.37	6.44
3	600036	招商银行	41,955,004.16	4.38
4	000718	苏宁环球	38,339,973.14	4.00
5	000838	国兴地产	27,469,320.83	2.87
6	600158	中体产业	26,968,418.09	2.82
7	600000	浦发银行	24,090,000.00	2.52
8	000709	河北钢铁	23,599,107.55	2.46
9	600185	格力地产	23,257,801.23	2.43
10	300131	英唐智控	22,520,309.90	2.35
11	601318	中国平安	21,802,340.00	2.28
12	000031	中粮地产	21,267,514.07	2.22
13	600016	民生银行	19,795,209.00	2.07
14	001696	宗申动力	19,520,223.96	2.04
15	600030	中信证券	19,333,920.44	2.02
16	000063	中兴通讯	18,768,111.32	1.96
17	600837	海通证券	16,980,182.00	1.77
18	600466	迪康药业	16,330,491.76	1.71
19	000069	华侨城 A	15,397,551.30	1.61
20	000592	平潭发展	15,018,885.70	1.57

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

**8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	600583	海油工程	101,019,044.71	10.55
2	601607	上海医药	77,157,805.52	8.06
3	601318	中国平安	62,950,358.35	6.58
4	600690	青岛海尔	62,650,406.96	6.54
5	002557	洽洽食品	57,228,198.24	5.98
6	002594	比亚迪	51,329,446.13	5.36
7	600511	国药股份	49,259,229.94	5.15
8	002230	科大讯飞	48,082,783.62	5.02
9	002331	皖通科技	41,339,547.00	4.32
10	000592	平潭发展	40,006,060.92	4.18
11	300131	英唐智控	32,231,949.37	3.37
12	002241	歌尔声学	30,432,531.64	3.18
13	600388	龙净环保	29,672,308.66	3.10
14	601601	中国太保	29,451,798.82	3.08
15	000838	国兴地产	27,843,223.57	2.91
16	600036	招商银行	27,768,256.01	2.90
17	002327	富安娜	27,338,130.49	2.86
18	600875	东方电气	26,001,867.35	2.72
19	600030	中信证券	25,219,691.93	2.63
20	601808	中海油服	24,944,677.01	2.61
21	601336	新华保险	24,256,996.78	2.53
22	600028	中国石化	22,244,562.34	2.32
23	600240	华业地产	21,163,868.33	2.21
24	601166	兴业银行	20,180,042.81	2.11
25	600518	康美药业	19,951,454.67	2.08

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

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,000,543,463.39
卖出股票收入（成交）总额	1,564,779,321.60

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

关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,883,000.00	0.30
8	其他	-	-
9	合计	2,883,000.00	0.30

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110030	格力转债	28,830	2,883,000.00	0.30

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货



## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	505,918.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,665.59
5	应收申购款	3,955.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	538,539.74

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600240	华业地产	47,770,301.88	4.99%	重大资产重组

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息(转型前)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
39,569	75,816.93	1,943,833,170.00	64.79%	1,056,166,830.00	35.21%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	441,696,614.00	14.72%
2	中国人寿保险股份有限公司	298,301,251.00	9.94%
3	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	200,341,821.00	6.68%
4	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	119,686,328.00	3.99%
5	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	61,621,128.00	2.05%
6	中国财产再保险股份有限公司	51,209,352.00	1.71%
7	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红	50,000,000.00	1.67%
8	中国大地财产保险股份有限公司	47,067,343.00	1.57%
9	泰康人寿保险股份有限公司—万能—一个险万能	46,013,696.00	1.53%
10	中国再保险（集团）股份有限公司	45,944,870.00	1.53%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司从业人员未持有本基金份额。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人以及本基金基金经理未持有本基金份额。

## §9 基金份额持有人信息(转型后)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
30,849	24,566.47	248,347,305.00	32.77%	509,503,578.97	67.23%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	南方基金管理有限公司	41,475,711.00	6.06%
2	宝钢集团有限公司	38,336,627.00	5.60%
3	中国人寿再保险股份有限 公司	35,562,255.00	5.19%
4	新华人寿保险股份有限公 司	19,956,330.00	2.91%
5	太平人寿保险有限公司	17,606,762.00	2.57%
6	光大证券—光大银行—光 大阳光基中宝（阳光2号 二期）集合资	8,334,058.00	1.22%
7	幸福人寿保险股份有限公 司—自有资金	7,820,148.00	1.14%
8	上海电气集团财务有限责 任公司	4,520,090.00	0.66%
9	程梦茜	3,990,000.00	0.58%
10	上海国有资产经营有限公 司	3,954,155.00	0.48%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	999.50	0.00%

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理未持有本基金份额。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2014年7月3日）基金份额总额	3,000,000,000.00
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,355,913.58
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,060,993,080.61
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）	-193,511,949.00
报告期期末基金份额总额	757,850,883.97

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

南方天元新产业股票型证券投资基金是根据原天元证券投资基金（以下简称“基金天元”）基金份额持有人大会2014年5月8日决议通过的《关于天元证券投资基金转型有关事项的议案》，同意将天元证券投资基金变更为南方天元新产业股票型证券投资基金。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

根据天元证券投资基金份额持有人大会决议，本基金投资策略修改为：“本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的”。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 137,000.00 元，该审计机构提供审计服务的第 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融有限公司	1	772,181,600.28	30.10%	683,304.25	29.65%	-
中投证券	1	565,919,593.10	22.06%	515,212.86	22.36%	-
平安证券	2	404,606,445.90	15.77%	359,689.37	15.61%	-
方正证券	1	401,111,898.70	15.64%	365,172.91	15.85%	-
浙商证券	1	163,966,600.30	6.39%	149,275.69	6.48%	-
国泰君安	1	114,020,934.40	4.44%	103,804.25	4.50%	-
广州证券	1	90,101,677.35	3.51%	79,730.96	3.46%	-
国信证券	2	53,414,035.10	2.08%	48,408.62	2.10%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-
中银证券	1	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融有限公司	-	-	300,000,000.00	27.27%	-	-
中投证券	6,063,780.30	46.01%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	7,116,788.00	53.99%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	800,000,000.00	72.73%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	553,343,032.29	24.83%	489,654.41	24.48%	-
中投证券	1	518,956,484.56	23.29%	472,458.97	23.62%	-
中金公司	1	269,318,167.34	12.09%	238,320.59	11.92%	-
中银证券	1	259,918,428.23	11.66%	236,631.87	11.83%	-
长江证券	1	253,125,746.77	11.36%	230,446.53	11.52%	-
兴业证券	1	228,553,487.36	10.26%	202,247.90	10.11%	-
广州证券	1	41,541,760.94	1.86%	36,760.26	1.84%	-
国泰君安	1	38,790,867.27	1.74%	35,315.12	1.77%	-
申银万国	2	35,837,927.29	1.61%	31,713.16	1.59%	-
银河证券	2	29,142,780.31	1.31%	26,531.47	1.33%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

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。