

南方策略优化股票型证券投资基金 2015 年半年度报告 摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 06 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方策略优化股票
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	382,254,629.57 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 lack-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，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券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	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

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

§ 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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	399,093,742.73
本期利润	271,275,107.46
加权平均基金份额本期利润	0.5196
本期基金份额净值增长率	62.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.5070
期末基金资产净值	576,055,443.61
期末基金份额净值	1.507

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、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

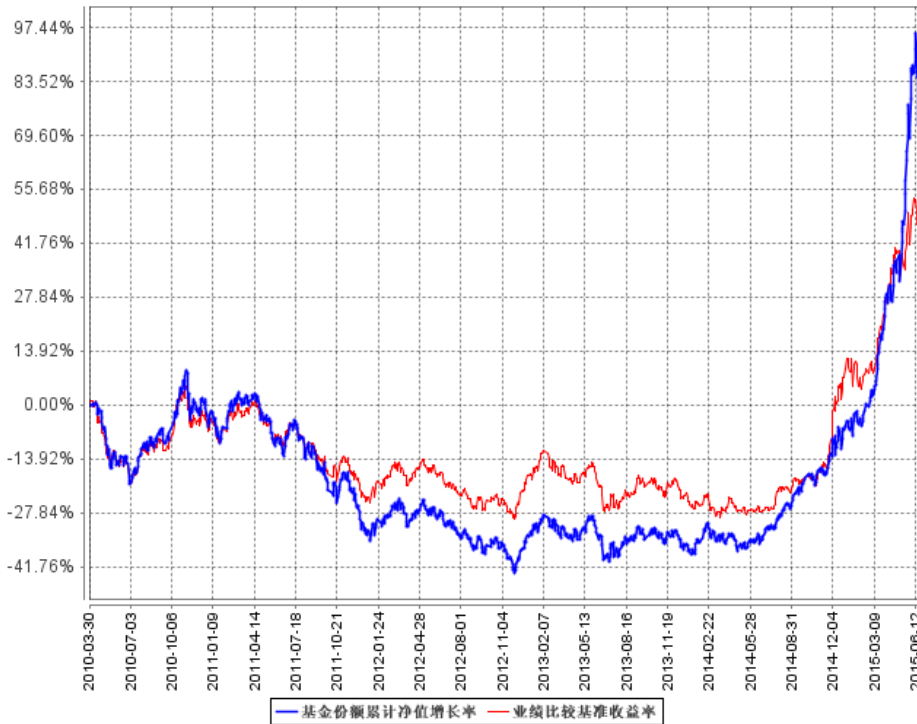
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.92%	3.45%	-5.84%	2.80%	-4.08%	0.65%

过去三个月	28.04%	2.63%	8.86%	2.09%	19.18%	0.54%
过去六个月	62.22%	2.07%	22.00%	1.81%	40.22%	0.26%
过去一年	129.03%	1.64%	81.80%	1.47%	47.23%	0.17%
过去三年	120.64%	1.38%	67.10%	1.19%	53.54%	0.19%
自基金合同生效起至今	53.70%	1.36%	33.20%	1.17%	20.50%	0.19%

Comment [w]: 图?

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

§ 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 3,500 亿元，旗下管理 73 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		
杨德龙	本基金基金经理	2013 年 3 月 15 日	-	8 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 月至今，任南方上证 380ETF 及联接基金基金经理；2013 年 3 月至今，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 12 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理。
雷俊	本基金基金经理	2015 年 6 月 16 日	-	7 年	北京大学工学硕士，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、量化投资部高级研究员；2014 年 12 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任南方中证 500 原材料 ETF 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，任南方国企改革、南方高铁、南方策略优化、大数据 300、南方 500 信息、南方量化成长的基金经理。
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 5 月 17 日	2015 年 6 月 19 日	10 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link

	理				Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，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，“离职日期”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《南方策略优化股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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 4 次，其中 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，3 次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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。上半年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，同期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 1.507；报告期内，基金份额净值增长率为 62.22%，同期业绩基准增长率为 22.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6 月中旬以来，A 股经历了一次比较大的市场调整，在连续多日大幅调整后，央行六月底宣布降息、降准，不断释放政策利好，市场预计在一段时间调整后将逐渐企稳。同时随着去杠杆化的推进和配资业务不断规范和政策导向，投资者对于风险收益的认知度不断提高，这将有助于股票市场健康平稳发展；另外，居民资产配置转移长期趋势仍未改变，中长期看仍有机会，下半年基金预计仍维持比较高的持仓比例，重点量化选择一些有基本面支撑的个股和行业，力图为投资者创造更好的超额回报。

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，组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。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，本报告期内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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司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》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内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

本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方策略优化股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		71,233,820.19	38,610,128.53
结算备付金		3,026,068.79	4,709,671.57
存出保证金		376,360.90	98,813.41
交易性金融资产		529,987,190.70	628,184,912.38
其中：股票投资		529,952,316.30	627,532,699.28
基金投资		-	-
债券投资		34,874.40	652,213.10
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		-	13,000,000.00
应收证券清算款		-	10,103,216.81
应收利息		12,954.11	11,358.99
应收股利		-	-
应收申购款		10,797,686.31	465,006.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		615,434,081.00	695,183,108.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		2,831.00	4,024,735.75
应付赎回款		33,340,191.20	3,272,587.42
应付管理人报酬		849,665.05	895,566.73
应付托管费		141,610.85	149,261.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,642,744.67	1,768,557.65
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		401,594.62	276,981.96
负债合计		39,378,637.39	10,387,690.63
所有者权益：			
实收基金		382,254,629.57	737,168,481.26
未分配利润		193,800,814.04	-52,373,063.29
所有者权益合计		576,055,443.61	684,795,417.97
负债和所有者权益总计		615,434,081.00	695,183,108.60

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.507 元，基金份额总额 382,254,629.57 份。

6.2 利润表

会计主体：南方策略优化股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		282,524,335.85	28,249,262.63
1.利息收入		467,110.96	952,912.09
其中：存款利息收入		195,458.95	56,734.69
债券利息收入		1,020.42	452,626.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		270,631.59	443,551.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		409,427,432.66	14,758,999.02
其中：股票投资收益		407,195,677.15	12,430,840.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益		407,507.25	629.72
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		1,824,248.26	2,327,528.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-127,818,635.27	12,532,849.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		448,427.50	4,501.53
减：二、费用		11,249,228.39	5,476,598.65
1. 管理人报酬		4,630,700.89	3,377,115.66
2. 托管费		771,783.59	562,852.62
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		5,663,416.29	1,344,823.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		183,327.62	191,806.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		271,275,107.46	22,772,663.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		271,275,107.46	22,772,663.98

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方策略优化股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	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（本期净利润）	-	271,275,107.46	271,275,107.46
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）	-354,913,851.69	-25,101,230.13	-380,015,081.82
其中：1.基金申购款	252,112,818.25	116,097,095.88	368,209,914.13

2. 基金赎回款	-607,026,669.94	-141,198,326.01	-748,224,995.95
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）	382,254,629.57	193,800,814.04	576,055,443.61
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	774,110,911.69	-289,244,895.93	484,866,015.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	22,772,663.98	22,772,663.98
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）	-107,492,872.31	38,265,656.16	-69,227,216.15
其中：1.基金申购款	12,853,712.87	-4,614,789.91	8,238,922.96
2.基金赎回款	-120,346,585.18	42,880,446.07	-77,466,139.11
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）	666,618,039.38	-228,206,575.79	438,411,463.59

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

基金管理人负责人

徐超

主管会计工作负责人

徐超

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方策略优化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]9号《关于核准南方策略优化股票型证券投资基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方策略优

《化股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,172,744,590.51 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 073 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方策略优化股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 3 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,173,254,149.88 份基金份额，其中认购资金利息折合 509,559.37 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方策略优化股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的各种股票、债券、短期金融工具、现金、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%，债券等固定收益类工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具的投资占基金资产的比例范围为 5%-40%。固定收益类工具主要包括国债、金融债、公司债(企业债)、央行票据、短期融资券、可转换债券、回购、资产证券化产品、货币市场工具等，其中现金以及到期日在 1 年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数。

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 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方策略优化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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年半年度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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

Comment [w]: 可以删除

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。
- (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, 由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税, 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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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(“南方基金公司”)	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

Comment [w]: 正文没有兴业证券

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华泰证券	566,990,218.34	15.62%	266,051,725.24	30.81%

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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

注：无。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例

注：无。

6.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	

	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
--	------	----------------------	------	----------------------

注：无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	501,737.29	15.45%	1,272,500.16	27.41%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	235,432.46	30.48%	231,314.09	45.97%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,630,700.89
其中：支付销售机构的客户维护费	1,291,542.98	1,046,740.64

注：支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月

	6 月 30 日	30 日
当期发生的基金应支付的托管费	771,783.59	562,852.62

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
		当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	=	
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
		当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	=	

注：无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注：无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金合同生效日(— 2010 年 3 月 30 日)—持有	=	=

的基金份额			
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		=	=
期末持有的基金份额 占基金总份额比例		=	=

注：1、期间申购总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回总份额含转换出份额。
2、因基金管理人持有本基金期限超过 2 年（按一般投资者标准：持有超过 2 年不收取赎回费），故无手续费。

6.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例

注：无。

6.4.8.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
招商银行	71,233,820.19	159,535.14	2,997,888.37	27,000.25

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
兴业证券	002089	新海宜	配股	124,819	450,596.59

上年度可比期间

Comment [w]: 正文是无。

Comment [w]: 正文在上年度里？

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
=	=	=	=	=	=

Comment [w]: 确认一下内容。正文没有这项，加？

Comment [w]: 内容有些和正文不一致

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）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

6.4.10.1.1 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

6.4.10.1.2 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	备注

6.4.10.1.3 受限证券类别：权证										
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：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

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。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002374	丽鹏股份	2015 年 6 月	重大事项	23.34	2015 年 7 月	22.50	121,600	3,414,305.98	2,838,144.00	

		30 日			13 日					
002530	丰东股份	2015 年 6 月 8 日	重大 事项	23.71	-	-	112,800	1,554,532.00	2,674,488.00	-
600167	联美控股	2015 年 5 月 27 日	重大 事项	25.76	-	-	97,327	1,884,963.28	2,507,143.52	-
300008	上海佳豪	2015 年 3 月 24 日	重大 事项	17.24	-	-	143,655	1,816,670.03	2,476,612.20	-
300346	南大光电	2015 年 6 月 25 日	重大 事项	35.49	-	-	68,580	2,139,124.79	2,433,904.20	-
002703	浙江世宝	2015 年 5 月 29 日	重大 事项	52.01	-	-	44,910	1,478,612.38	2,335,769.10	-
000766	通化金马	2015 年 3 月 20 日	重大 事项	8.47	-	-	267,410	1,842,558.37	2,264,962.70	-
002003	伟星股份	2015 年 6 月 5 日	重大 事项	16.17	-	-	139,512	1,795,504.10	2,255,909.04	-
002075	沙钢股份	2015 年 6 月 25 日	重大 事项	33.00	-	-	63,500	1,709,004.00	2,095,500.00	-
300249	依米康	2015 年 5 月 29 日	重大 事项	35.00	-	-	56,000	1,170,888.18	1,960,000.00	-
000679	大连友谊	2015 年 5 月 28 日	重大 事项	16.48	-	-	116,323	1,194,457.63	1,917,003.04	-
002183	怡亚通	2015 年 6 月	重大 事项	73.15	-	-	24,400	911,622.58	1,784,860.00	-

		1 日								
300084	海默科技	2015 年 6 月 3 日	重大 事项	21.43	2015 年 7 月 20 日	19.29	82,060	1,514,226.46	1,758,545.80	-
300190	维尔利	2015 年 5 月 25 日	重大 事项	34.34	-	-	51,200	1,238,676.96	1,758,208.00	-
601111	中国国航	2015 年 6 月 30 日	重大 事项	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	111,400	1,321,567.96	1,711,104.00	-
000668	荣丰控股	2015 年 5 月 25 日	重大 事项	34.79	-	-	45,349	881,136.31	1,577,691.71	-
000567	海德股份	2015 年 6 月 17 日	重大 事项	33.71	2015 年 8 月 6 日	30.34	45,700	1,426,308.00	1,540,547.00	-
300214	日科化学	2015 年 5 月 18 日	重大 事项	10.09	2015 年 7 月 22 日	9.22	150,500	1,326,527.00	1,518,545.00	-
000720	新能泰山	2015 年 6 月 12 日	重大 事项	17.01	-	-	88,500	838,368.67	1,505,385.00	-
600393	东华实业	2015 年 6 月 18 日	重大 事项	17.61	2015 年 7 月 1 日	15.85	78,500	851,395.54	1,382,385.00	-
000839	中信国安	2015 年 6 月 29 日	重大 事项	23.57	-	-	57,800	1,085,337.78	1,362,346.00	-
002209	达意隆	2015 年 6 月 8 日	重大 事项	26.54	2015 年 7 月 13 日	23.89	49,000	1,339,915.00	1,300,460.00	-
000707	双环科技	2015 年 6 月	重大 事项	11.61	-	-	111,200	868,957.46	1,291,032.00	-

		9 日								
002671	龙泉股份	2015 年 6 月 17 日	重大 事项	23.89	-	-	52,600	882,765.00	1,256,614.00	-
600310	桂东电力	2015 年 6 月 30 日	重大 事项	31.53	2015 年 7 月 13 日	34.68	39,700	1,669,162.00	1,251,741.00	-
002591	恒大高新	2015 年 6 月 24 日	重大 事项	19.95	2015 年 7 月 17 日	17.96	62,400	805,360.88	1,244,880.00	-
600075	新疆天业	2015 年 6 月 4 日	重大 事项	16.00	-	-	74,800	735,192.00	1,196,800.00	-
002336	人人乐	2015 年 6 月 9 日	重大 事项	25.53	2015 年 8 月 6 日	22.98	45,300	760,292.00	1,156,509.00	-
002329	皇氏集团	2015 年 6 月 12 日	重大 事项	69.48	2015 年 8 月 13 日	62.53	16,500	582,973.38	1,146,420.00	-
600113	浙江东日	2015 年 6 月 16 日	重大 事项	18.08	2015 年 7 月 8 日	16.27	62,400	892,280.00	1,128,192.00	-
600355	精伦电子	2015 年 6 月 29 日	重大 事项	20.71	-	-	53,600	884,148.23	1,110,056.00	-
000035	中国天楹	2015 年 6 月 17 日	重大 事项	23.43	2015 年 7 月 17 日	21.09	46,900	888,998.98	1,098,867.00	-
002045	国光电器	2015 年 6 月 1 日	重大 事项	13.92	2015 年 7 月 14 日	12.53	78,500	767,986.78	1,092,720.00	-
002043	兔宝宝	2015 年 6 月	重大 事项	12.84	-	-	83,750	578,857.43	1,075,350.00	-

		1 日								
002239	金飞达	2015 年 5 月 25 日	重大 事项	18.33	-	-	58,300	779,418.00	1,068,639.00	-
002398	建研集团	2015 年 6 月 8 日	重大 事项	28.49	2015 年 7 月 1 日	25.64	36,485	776,805.78	1,039,457.65	-
000545	金浦钛业	2015 年 5 月 18 日	重大 事项	21.34	-	-	47,600	757,014.46	1,015,784.00	-
002012	凯恩股份	2015 年 5 月 28 日	重大 事项	14.00	2015 年 7 月 1 日	12.60	72,022	742,236.64	1,008,308.00	-
002377	国创高新	2015 年 6 月 26 日	重大 事项	13.32	2015 年 7 月 3 日	11.99	73,920	758,284.91	984,614.40	-
002558	世纪游轮	2014 年 10 月 27 日	重大 事项	31.65	-	-	31,002	835,907.07	981,213.30	-
002639	雪人股份	2015 年 6 月 30 日	重大 事项	38.30	-	-	25,490	823,089.13	976,267.00	-
300184	力源信息	2015 年 6 月 8 日	重大 事项	25.94	-	-	37,100	517,093.05	962,374.00	-
300135	宝利国际	2015 年 6 月 29 日	重大 事项	12.65	-	-	75,760	929,133.00	958,364.00	-
300116	坚瑞消防	2015 年 6 月 23 日	重大 事项	15.62	2015 年 7 月 3 日	9.36	59,500	1,118,705.00	929,390.00	-
300113	顺网科技	2015 年 5 月	重大 事项	57.70	2015 年 8 月	51.93	15,000	933,015.69	865,500.00	-

		5 日			6 日					
300196	长海股份	2015 年 5 月 18 日	重大事项	35.41	-	-	23,200	747,363.00	821,512.00	-
300030	阳普医疗	2015 年 6 月 25 日	重大事项	27.34	2015 年 7 月 2 日	24.61	29,500	782,620.00	806,530.00	-
600099	林海股份	2015 年 4 月 15 日	重大事项	13.37	-	-	57,690	805,189.41	771,315.30	-
000592	平潭发展	2015 年 6 月 30 日	重大事项	29.76	2015 年 7 月 14 日	30.00	25,900	657,613.25	770,784.00	-
002370	亚太药业	2015 年 4 月 28 日	重大事项	24.45	-	-	31,400	695,767.16	767,730.00	-
600807	天业股份	2015 年 6 月 30 日	重大事项	21.31	-	-	35,900	734,890.73	765,029.00	-
000607	华媒控股	2015 年 6 月 29 日	重大事项	14.56	2015 年 7 月 1 日	15.16	51,200	965,474.00	745,472.00	-
300071	华谊嘉信	2015 年 5 月 21 日	重大事项	13.66	-	-	54,000	690,030.35	737,640.00	-
600053	中江地产	2015 年 3 月 23 日	重大事项	13.14	-	-	55,500	497,677.84	729,270.00	-
300323	华灿光电	2015 年 4 月 29 日	重大事项	9.38	-	-	75,476	547,127.85	707,964.88	-
002545	东方铁塔	2015 年 5 月	重大事项	26.79	-	-	25,300	573,283.00	677,787.00	-

		19 日								
002272	川润股份	2015 年 4 月 20 日	重大 事项	11.20	-	-	60,300	598,477.96	675,360.00	-
000813	天山纺织	2015 年 5 月 4 日	重大 事项	11.25	-	-	58,300	651,469.13	655,875.00	-
600246	万通地产	2015 年 1 月 6 日	重大 事项	5.32	2015 年 7 月 6 日	5.85	118,860	498,496.53	632,335.20	-
600869	智慧能源	2015 年 5 月 11 日	重大 事项	29.14	2015 年 7 月 31 日	26.23	19,400	512,113.00	565,316.00	-
000416	民生控股	2015 年 5 月 29 日	重大 事项	17.52	-	-	27,200	332,746.67	476,544.00	-
002577	雷柏科技	2015 年 6 月 10 日	重大 事项	80.60	-	-	5,310	318,334.14	427,986.00	-
000850	华茂股份	2015 年 5 月 7 日	重大 事项	10.98	-	-	37,900	424,127.00	416,142.00	-
000748	长城信息	2015 年 6 月 18 日	重大 事项	34.88	-	-	11,500	300,176.61	401,120.00	-
601633	长城汽车	2015 年 6 月 19 日	重大 事项	42.76	2015 年 7 月 13 日	38.50	7,700	384,025.28	329,252.00	-
300297	蓝盾股份	2015 年 4 月 30 日	重大 事项	31.99	2015 年 7 月 20 日	33.00	9,900	310,071.60	316,701.00	-
000878	云南铜业	2015 年 6 月	重大 事项	24.50	-	-	12,700	222,929.93	311,150.00	-

		8 日								
600879	航天电子	2015 年 5 月 15 日	重大事项	24.50	-	-	12,400	236,376.75	303,800.00	-
300291	华录百纳	2015 年 6 月 30 日	重大事项	37.76	2015 年 7 月 13 日	34.65	7,958	246,517.92	300,494.08	-
002020	京新药业	2015 年 4 月 16 日	重大事项	27.21	2015 年 8 月 10 日	26.10	9,200	239,560.00	250,332.00	-
002292	奥飞动漫	2015 年 5 月 18 日	重大事项	37.85	-	-	5,334	149,575.86	201,891.90	-
002649	博彦科技	2015 年 6 月 1 日	重大事项	83.81	-	-	2,400	141,109.33	201,144.00	-
000881	大连国际	2015 年 4 月 22 日	重大事项	13.15	-	-	13,600	152,369.96	178,840.00	-
002416	爱施德	2015 年 5 月 5 日	重大事项	20.67	2015 年 7 月 29 日	18.60	8,300	170,079.50	171,561.00	-
002546	新联电子	2015 年 6 月 17 日	重大事项	33.16	2015 年 7 月 16 日	29.84	4,100	94,628.00	135,956.00	-
002214	大立科技	2015 年 6 月 15 日	重大事项	20.90	-	-	6,200	104,901.19	129,580.00	-
002620	瑞和股份	2015 年 6 月 9 日	重大事项	58.49	2015 年 8 月 13 日	52.55	1,664	49,414.45	97,327.36	-
300158	振东制药	2015 年 4 月	重大事项	18.90	-	-	5,000	96,033.33	94,500.00	-

		27 日									
002289	宇顺电子	2015 年 6 月 11 日	重大 事项	44.95	-	-	2,100	64,401.80	94,395.00	-	
300056	三维丝	2015 年 6 月 5 日	重大 事项	46.55	-	-	2,000	66,428.43	93,100.00	-	
002199	东晶电子	2015 年 4 月 20 日	重大 事项	14.92	-	-	6,200	86,075.43	92,504.00	-	
002320	海峡股份	2015 年 6 月 26 日	重大 事项	27.43	-	-	3,200	82,705.00	87,776.00	-	
300031	宝通带业	2015 年 6 月 11 日	重大 事项	22.82	-	-	3,700	48,609.64	84,434.00	-	
600097	开创国际	2015 年 6 月 5 日	重大 事项	30.40	-	-	2,700	66,663.00	82,080.00	-	
000665	湖北广电	2015 年 5 月 25 日	重大 事项	27.90	-	-	2,800	54,206.46	78,120.00	-	
002238	天威视讯	2015 年 6 月 29 日	重大 事项	23.76	-	-	2,601	51,982.36	61,799.76	-	
002557	洽洽食品	2015 年 6 月 29 日	重大 事项	16.38	-	-	3,600	74,945.50	58,968.00	-	
002498	汉缆股份	2015 年 6 月 30 日	重大 事项	20.57		2015 年 7 月 20 日	22.63	2,600	38,142.00	53,482.00	-
002309	中利科技	2015 年 6 月	重大 事项	33.39		2015 年 7 月	30.05	1,500	46,890.00	50,085.00	-

		2 日			21 日					
002464	金利科技	2015 年 1 月 26 日	重大 事项	16.14	2015 年 7 月 28 日	17.75	2,900	50,514.57	46,806.00	-
002662	京威股份	2015 年 5 月 15 日	重大 事项	17.84	2015 年 8 月 13 日	16.06	2,600	45,500.00	46,384.00	-
002676	顺威股份	2015 年 4 月 20 日	重大 事项	26.94	2015 年 7 月 29 日	24.25	1,700	48,212.00	45,798.00	-
002688	金河生物	2015 年 6 月 2 日	重大 事项	29.70	2015 年 7 月 14 日	26.73	500	13,480.00	14,850.00	-
000862	银星能源	2015 年 5 月 21 日	重大 事项	11.81	-	-	1,100	11,341.00	12,991.00	-
000024	招商地产	2015 年 4 月 3 日	重大 事项	36.51	-	-	67,129	1,792,528.47	2,450,879.79	-
000543	皖能电力	2015 年 6 月 15 日	重大 事项	18.53	2015 年 7 月 14 日	19.22	8,500	137,849.13	157,505.00	-
000716	黑芝麻	2015 年 6 月 8 日	重大 事项	20.98	2015 年 8 月 3 日	21.32	39,097	918,399.54	820,255.06	-
000732	泰禾集团	2015 年 6 月 25 日	重大 事项	30.36	2015 年 7 月 2 日	22.91	29,467	946,158.09	894,618.12	-
000786	北新建材	2015 年 4 月 10 日	重大 事项	19.13	-	-	19,400	212,427.80	371,122.00	-
000793	华闻传媒	2015 年 5 月	重大 事项	16.89	-	-	19,500	296,434.88	329,355.00	-

		26 日								
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大 事项	30.81	-	-	11,600	317,806.90	357,396.00	-
002002	鸿达兴业	2015 年 6 月 18 日	重大 事项	30.52	-	-	41,400	938,636.72	1,263,528.00	-
002264	新华都	2015 年 3 月 11 日	重大 事项	11.67	2015 年 6 月 30 日	9.35	273,864	2,014,907.63	3,195,992.88	-
002268	卫士通	2015 年 5 月 8 日	重大 事项	80.14	2015 年 8 月 4 日	76.32	5,500	437,452.63	440,770.00	-
002308	威创股份	2015 年 6 月 12 日	重大 事项	23.15	-	-	7,200	127,531.42	166,680.00	-
002388	新亚制程	2015 年 5 月 20 日	重大 事项	26.74	-	-	54,300	1,142,807.00	1,451,982.00	-
002445	中南重工	2015 年 6 月 2 日	重大 事项	51.39	-	-	17,488	685,152.07	898,708.32	-
002624	完美环球	2015 年 3 月 24 日	重大 事项	32.90	2015 年 7 月 1 日	5.65	99,004	1,860,287.52	3,257,231.60	-
300028	金亚科技	2015 年 6 月 10 日	重大 事项	27.00	-	-	20,800	789,364.00	561,600.00	-
300203	聚光科技	2015 年 4 月 20 日	重大 事项	41.19	2015 年 8 月 12 日	33.88	11,400	374,526.00	469,566.00	-
300287	飞利信	2015 年 6 月	重大 事项	38.08	-	-	10,600	319,665.61	403,648.00	-

		2 日								
600645	中源协和	2015 年 4 月 27 日	重大事项	81.32	-	-	4,800	325,067.52	390,336.00	-
000850	华贸股份	2015 年 5 月 7 日	重大事项	10.98	-	-	37,900	424,127.00	416,142.00	-
000665	湖北广电	2015 年 5 月 25 日	重大事项	27.90	-	-	2,800	54,206.46	78,120.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

=

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
合计				=	=

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	529,952,316.30	86.11
	其中：股票	529,952,316.30	86.11
2	固定收益投资	34,874.40	0.01

	其中：债券	34,874.40	0.01
	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	74,259,888.98	12.07
7	其他各项资产	11,187,001.32	1.82
8	合计	615,434,081.00	100.00

Comment [w]: 内容和正文不一致

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,875,351.43	2.41
B	采矿业	5,191,230.68	0.90
C	制造业	319,274,419.60	55.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,060,987.58	4.31
E	建筑业	6,167,853.56	1.07
F	批发和零售业	27,963,142.58	4.87
G	交通运输、仓储和邮政业	11,141,138.00	1.93
H	住宿和餐饮业	98,340.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,281,380.88	2.48
J	金融业	54,764,955.02	9.51
K	房地产业	27,071,548.68	4.70
L	租赁和商务服务业	3,888,779.04	0.68
M	科学研究和技术服务业	4,555,099.65	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	8,348,243.36	1.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	600,512.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	6,715,131.91	1.17
S	综合	1,099,755.82	0.19

	合计	529,952,316.30	92.00
--	----	----------------	-------

7.3 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	601318	中国平安	63,427	5,197,208.38	0.90
2	600016	民生银行	478,600	4,757,284.00	0.83
3	600030	中信证券	152,860	4,113,462.60	0.71
4	601166	兴业银行	219,900	3,793,275.00	0.66
5	600000	浦发银行	207,800	3,524,288.00	0.61
6	002569	步森股份	170,200	3,477,186.00	0.60
7	002201	九鼎新材	165,461	3,342,312.20	0.58
8	600837	海通证券	151,689	3,306,820.20	0.57
9	002624	完美环球	99,004	3,257,231.60	0.57
10	002264	新华都	273,864	3,195,992.88	0.55

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> 的半年度报告正文。-

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	601169	北京银行	19,001,586.04	2.77
2	600030	中信证券	14,123,113.70	2.06
3	601601	中国太保	11,974,205.67	1.75
4	601318	中国平安	11,628,210.93	1.70
5	600837	海通证券	10,977,069.14	1.60
6	601166	兴业银行	8,712,955.18	1.27
7	600016	民生银行	8,682,163.12	1.27
8	601788	光大证券	7,184,781.00	1.05
9	000838	国兴地产	6,803,967.57	0.99

10	300043	互动娱乐	6,749,159.01	0.99
11	600048	保利地产	6,705,359.00	0.98
12	000651	格力电器	6,540,461.99	0.96
13	601328	交通银行	6,348,936.00	0.93
14	000001	平安银行	6,269,756.04	0.92
15	002562	兄弟科技	5,991,859.48	0.87
16	000024	招商地产	5,892,111.05	0.86
17	600000	浦发银行	5,828,397.33	0.85
18	002075	沙钢股份	5,671,192.84	0.83
19	600383	金地集团	5,515,469.88	0.81
20	000069	华侨城 A	5,383,950.44	0.79

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	601318	中国平安	22,294,301.44	3.26
2	601169	北京银行	19,886,882.97	2.90
3	601166	兴业银行	19,201,241.25	2.80
4	601668	中国建筑	19,087,985.32	2.79
5	601390	中国中铁	18,837,422.90	2.75
6	600837	海通证券	18,778,362.55	2.74
7	600030	中信证券	17,247,110.02	2.52
8	600000	浦发银行	16,594,998.65	2.42
9	600016	民生银行	15,484,121.30	2.26
10	601818	光大银行	15,018,201.45	2.19
11	600015	华夏银行	14,895,394.76	2.18
12	601988	中国银行	14,715,858.47	2.15
13	600999	招商证券	14,561,696.32	2.13
14	000776	广发证券	14,088,444.18	2.06
15	000686	东北证券	13,676,175.12	2.00
16	601336	新华保险	12,601,969.54	1.84
17	601628	中国人寿	12,104,916.20	1.77
18	601601	中国太保	11,899,475.02	1.74
19	601328	交通银行	11,806,537.45	1.72

20	601800	中国交建	11,525,702.71	1.68
----	--------	------	---------------	------

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	1,626,323,020.41
卖出股票收入（成交）总额	2,003,419,783.97

注：买入股票成本、卖出股票成本均按照买卖成交金额（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

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	34,874.40	0.01
8	其他	-	-
9	合计	34,874.40	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	240	34,874.40	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					=
国债期货投资本期收益(元)					=
国债期货投资本期公允价值变动(元)					=

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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除步森股份（002569）外，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。根据二〇一五年五月十四日浙江步森服饰股份有限公司（下称步森股份，股票代码：002569）《浙江步森服饰股份有限公司关于收到中国证监会调查通知书的公告》，步森股份于2015年5月12日接到中国证券监督管理委员会调查通知书（桂证调查通字2015017号），因涉嫌违反证券法律法规，中国证券监督管理委员会决定根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，对步森股份并购康华农业事项立案调查。截至本报告期末，步森股份尚未收到中国证监会就上述立案调查的结论性意见。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。【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

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	376,360.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,954.11
5	应收申购款	10,797,686.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

Comment [w]: 正文不一致

9	合计	11,187,001.32
---	----	---------------

7.12.4 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(%)
----	------	------	------	--------------

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002624	完美环球	3,257,231.60	0.57	筹划重大事项
2	002264	新华都	3,195,992.88	0.55	筹划重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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
16,422	23,276.98	21,607,599.70	5.65%	360,647,029.87	94.35%

8.3.2 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	651,597.64	0.1705%

8.4.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年3月30日）基金份额总额	2,173,254,149.88
本报告期期初基金份额总额	737,168,481.26
本报告期基金总申购份额	252,112,818.25
减：本报告期基金总赎回份额	607,026,669.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	382,254,629.57

§ 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

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于2015年5月29日发布公告，聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

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，无涉及基金管理人业务、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	
广发证券	1	1,684,182,360.15	46.40%	1,490,338.50	45.90%	-
中投证券	1	759,323,805.37	20.92%	691,282.05	21.29%	-
银河证券	1	611,022,140.55	16.83%	556,288.65	17.13%	-
华泰证券	2	566,990,218.34	15.62%	501,737.29	15.45%	-
华创证券	1	8,224,279.97	0.23%	7,487.40	0.23%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：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

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程

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

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	910,945.50	100.00%	1,511,000,000.00	96.06%	-	-
银河证券	-	-	62,000,000.00	3.94%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

--

南方基金管理有限公司
2015 年 8 月 25 日