

# 南方优选价值混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 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：2016 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本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 2015 年 01 月 01 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	南方优选价值混合
基金主代码	202011
前端交易代码	202011
后端交易代码	202012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 18 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	533,970,935.85 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“南方价值”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，采用自下而上优选的模式，投资于资产价值有保障、并且具备价值释放条件（盈利能力持续稳定或处于经营反转）的上市公司，实现基金资产的长期、稳定增值。
------	---

投资策略	采用“自下而上”的策略，比较上市公司的现有账面资产价值与股票投资价值，优选未来价值能够释放（盈利能力持续稳定或处于经营反转，未来两年盈利增长高于 GDP 增长）的上市公司作为主要投资对象。同时结合“自上而下”的行业分析，根据对宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以发现能够改变个股未来价值释放能力的系统性条件，从而以最低的组合风险优选并确定最优质的股票组合。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	洪渊
	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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	760,911,140.26	473,326,699.88	162,757,196.39
本期利润	770,157,965.58	393,432,184.86	210,075,152.17
加权平均基金份额本期利润	1.1514	0.3300	0.1396
本期基金份额净值增长率	69.66%	35.16%	12.85%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	1.2118	0.3974	-0.0869

期末基金资产净值	1,299,740,152.09	1,444,666,759.60	1,614,760,137.20
期末基金份额净值	2.434	1.626	1.203

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。

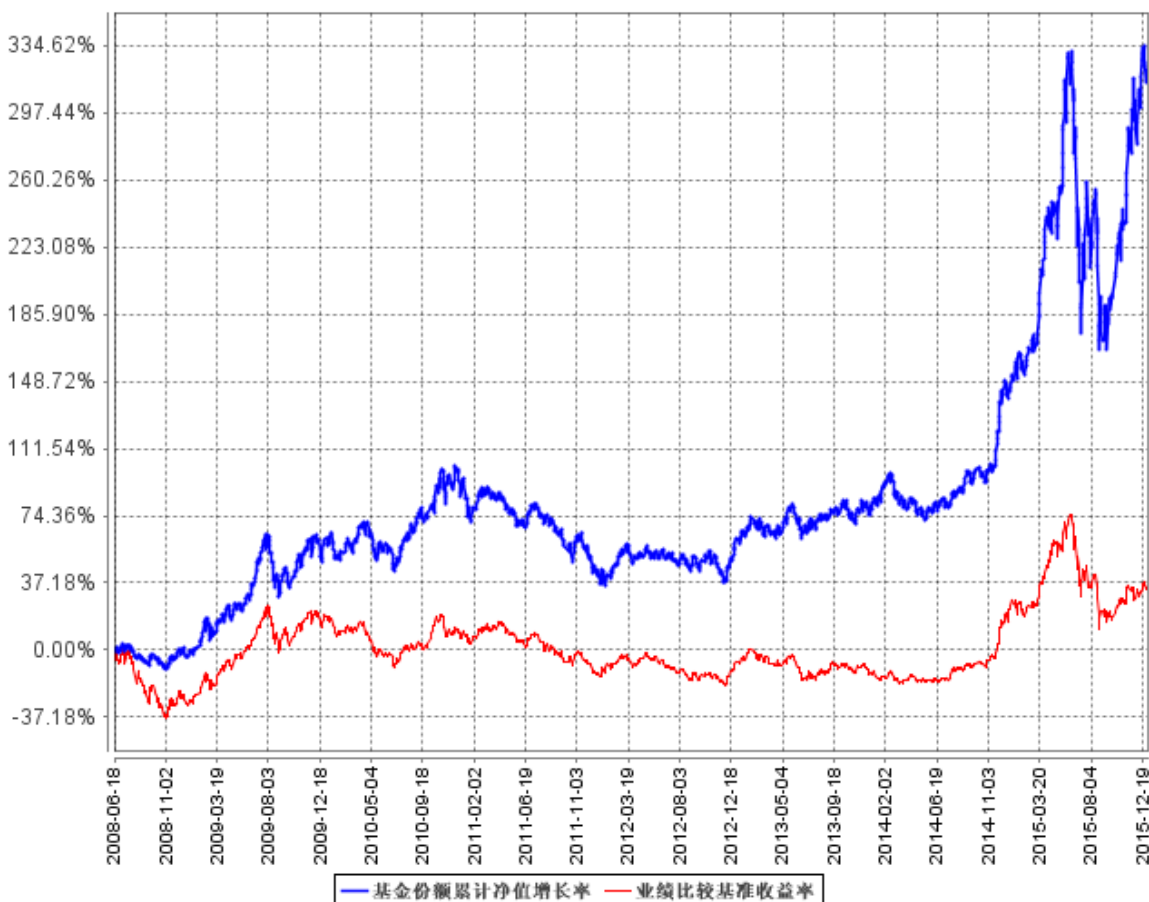
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	41.84%	2.28%	13.57%	1.34%	28.27%	0.94%
过去六个月	21.15%	3.02%	-12.31%	2.14%	33.46%	0.88%
过去一年	69.66%	2.63%	6.98%	1.99%	62.68%	0.64%
过去三年	158.79%	1.74%	43.01%	1.43%	115.78%	0.31%
过去五年	115.22%	1.50%	22.97%	1.29%	92.25%	0.21%
自基金合同生效起至今	317.64%	1.48%	33.35%	1.45%	284.29%	0.03%

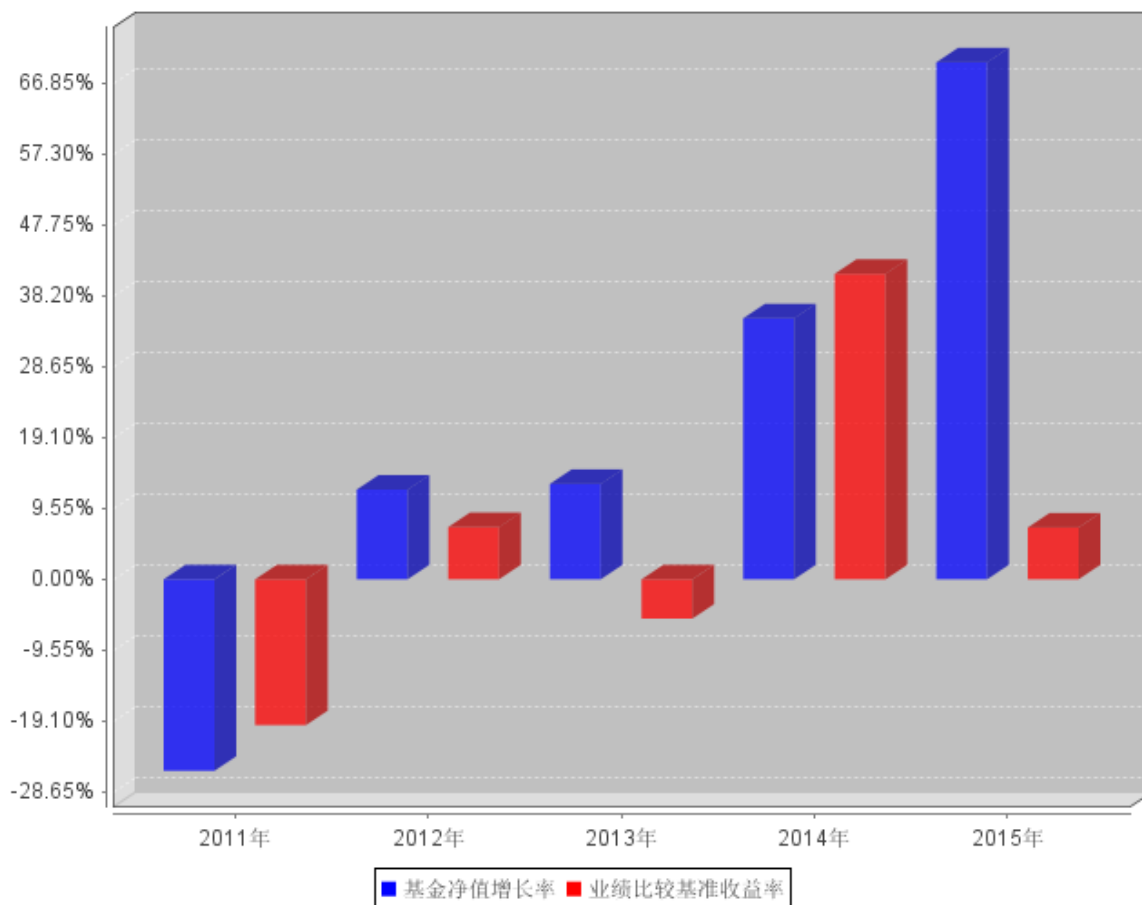
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

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对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	2.0000	87,822,349.44	59,514,277.29	147,336,626.73	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	2.0000	87,822,349.44	59,514,277.29	147,336,626.73	

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司

(45%)；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 5,000 亿元，旗下管理 85 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
骆帅	本基金基金经理	2015 年 6 月 19 日	-	6 年	清华大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格，2009 年 7 月加入南方基金，担任研究部研究员、高级研究员；2014 年 3 月至 2015 年 5 月，任南方成份、南方安心基金经理助理；2015 年 5 月至今，任南方高端装备基金经理；2015 年 6 月至今，任南方价值、南方成长基金经理。
罗安安	本基金基金经理	2015 年 7 月 10 日	-	5 年	清华大学计算机科学与技术专业博士，具有基金从业资格，2010 年 7 月加入南方基金，担任研究部高级研究员；2014 年 3 月至 2014 年 11 月，担任南方成长、南方价值基金经理助理；2014 年 11 月至 2015 年 7 月，担任投资经理；2015 年 7 月至今，任南方价值基金经理。
谈建强	本基金基金经理	2008 年 6 月 18 日	2015 年 7 月 10 日	19 年	经济学硕士，注册会计师，具有基金从业资格。曾任职于上海申华实业股份有限公司、海南港澳国际信托投资公司、中海信托投资有限责任公司。2006 年 9 月加入南方基金，2006 年 12 月至 2008 年 6 月，任南方绩优基金经理；2008 年 4 月至 2013 年 4 月，任南方高增基金经理；

					2008年6月至2015年7月， 任南方价值基金经理； 2011年1月至2015年7月， 任南方成长基金经理。
--	--	--	--	--	--

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，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方优选价值混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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同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 9 次，其中 5 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，2 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，2 次是由于投资组合的投资策略需要，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

2015 年初始，中国经济增长速度有所放缓，但我们对政府经济新常态下推动改革转型的决心仍然充满信心，经济政策继续呈现积极宽松的局面。继去年主板市场形成底部并大幅上扬以后，一季度前两个月市场维持震荡整理格局，三月份上证指数成功突破 2009 年反弹高点，上升空间进一步打开。我们在一季度维持对市场乐观的看法，保持了较高的股票投资比例，并积极优化组合结构，季度末组合开始趋向均衡，对部分估值偏高的成长股选择获利了结，并增加了大盘蓝筹股尤其是金融行业的配置比例。

六月份股灾发生以来，我们意识到杠杆牛市的结束存在着一次剧烈挤泡沫的过程，所以基金始终保持了适中仓位和谨慎操作，在配置上倾向于传媒、消费行业中的中盘蓝筹，以及有业绩支持的国企改革标的。同时以积极心态等待市场反弹时的适度抄底。进入四季度，九月份大盘 2850 点筑底成功，我们较早判断将有一波机构加仓的行情，积极转变风格，加持部分前期跌幅过大或基本面良好、有业绩兑现的优秀成长股，配置弹性品种，勇于加仓，把握了市场反弹机会。十一月份下旬，市场越来越受到美国加息和人民币贬值的影响，成交量出现明显缩量，预计前期反弹过大的板块存在回调压力，我们及时作出了“结构强势，指数走弱”的判断，基金由配置操作转为灵活操作，主攻强势主题和精选个股，主题领域积极布局新能源汽车、虚拟现实、云计算等，仓位适中，应对指数走弱带来的回调压力，近期取得了明显的相对收益。

### 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 2.434 元，本报告期份额净值增长率为 69.66%，同期业绩比较基准增长率为 6.98%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为南方基金管理有限公司的公募老产品，虽然在期中更换了基金经理，但始终一直

秉持着做长期价值投资的理念，以为投资者高度勤勉尽责的态度，为广大基民创造收益回报，希望广大基民投资者给予新任基金经理充分的信任。

展望 2016 年一季度，宏观经济大概率将企稳，物价压力不大，汇率贬值预期会进一步限制货币政策适度宽松的幅度，政府转变财政刺激需求的做法，更侧重于供给侧改革，这一点值得我们投资者高度重视，结合煤炭钢铁指数的长期弱势，有望在市场趋稳过程中走出强劲反弹。市场方面，指数在去杠杆的过程中基本筑底完成，上证指数预计将在 3000~3700 点宽幅震荡，个股将出现大幅度分化，有业绩持续增长支撑的优质成长股将率先企稳回升，而估值泡沫化的股票将继续“挤泡沫”，我们对于个股选择将更加精益求精，着重挖掘公司的长期成长价值，而非短期主题热炒。同时由于供给侧改革的政策陆续推出，未来传统产业受益于产能收缩和供给调整可能存在明显的反弹机会，重点关注煤炭和钢铁。

最后，我们认为转型牛、改革牛并未结束，随着中央五中全会的召开以及十三五规划制定进程临近，主题热点仍将不断涌现，叠加周期类超跌板块的适度反弹，市场存量资金交易活跃，带动寻求高收益的增量资金入市，未来仍然有获取绝对收益的较好时机。接下来，我们将继续保持谨慎积极的投资风格、相对均衡的结构配置，精选具有优质成长以及超跌价值的个股，紧抓波段，在尽量降低净值波动的条件下，创造更好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对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：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，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 50%，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，投资

者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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；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，本基金于 2016 年 1 月 20 日进行本基金的 2015 年年度收益分配（每 10 份基金份额派发红利 6.06 元）；本报告期内 2015 年 1 月 16 日已分配数（每 10 份基金份额派发红利 2.00 元）为以往年度收益分配。

#### **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优选价值混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方优选价值混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方优选价值混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方优选价值混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 147,336,626.73 元。

### **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优选价值混合型证券投资基金 2015 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

本基金本报告期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(2016)第 21260 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察看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:南方优选价值混合型证券投资基金

报告截止日:2015 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	118,876,271.79	278,529,777.60
结算备付金	11,253,556.18	1,993,640.79
存出保证金	1,583,083.51	709,376.53
交易性金融资产	1,164,506,340.87	1,044,024,581.20
其中:股票投资	1,164,506,340.87	1,044,024,581.20
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	-	150,000,000.00
应收证券清算款	15,946,601.35	-
应收利息	41,571.13	99,944.60
应收股利	-	-
应收申购款	2,414,849.54	1,454,065.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,314,622,274.37	1,476,811,385.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-

应付证券清算款		-	20,097,843.75
应付赎回款		7,240,553.71	7,737,467.80
应付管理人报酬		1,587,129.27	1,754,713.84
应付托管费		264,521.54	292,452.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5,672,298.27	1,934,407.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		117,619.49	327,741.51
负债合计		14,882,122.28	32,144,626.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		533,970,935.85	888,355,367.19
未分配利润		765,769,216.24	556,311,392.41
所有者权益合计		1,299,740,152.09	1,444,666,759.60
负债和所有者权益总计		1,314,622,274.37	1,476,811,385.81

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.434 元，基金份额总额 533,970,935.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方优选价值混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	817,864,932.77	428,827,801.68
1. 利息收入	1,950,120.89	3,880,589.30
其中：存款利息收入	1,739,012.27	2,442,572.18
债券利息收入	1,475.41	70,325.27
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	209,633.21	1,367,691.85
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	804,075,119.24	503,704,058.46
其中：股票投资收益	796,281,177.93	486,012,729.32
基金投资收益	-	-
债券投资收益	40.00	1,827,754.73
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		7,793,901.31	15,863,574.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		9,246,825.32	-79,894,515.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2,592,867.32	1,137,668.94
<b>减：二、费用</b>		47,706,967.19	35,395,616.82
1. 管理人报酬		19,247,036.75	22,554,910.75
2. 托管费		3,207,839.44	3,759,151.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		24,846,354.13	8,664,975.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		405,736.87	416,578.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		770,157,965.58	393,432,184.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		770,157,965.58	393,432,184.86

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方优选价值混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	888,355,367.19	556,311,392.41	1,444,666,759.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	770,157,965.58	770,157,965.58
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）	-354,384,431.34	-413,363,515.02	-767,747,946.36
其中：1. 基金申购款	999,125,512.61	939,578,198.14	1,938,703,710.75
2. 基金赎回款	-1,353,509,943.95	-1,352,941,713.16	-2,706,451,657.11

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）	-	-147,336,626.73	-147,336,626.73
五、期末所有者权益（基金净值）	533,970,935.85	765,769,216.24	1,299,740,152.09
项目	上年度可比期间 2014年1月1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）	1,341,798,305.39	272,961,831.81	1,614,760,137.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	393,432,184.86	393,432,184.86
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）	-453,442,938.20	-110,082,624.26	-563,525,562.46
其中：1. 基金申购款	630,554,246.41	197,486,394.16	828,040,640.57
2. 基金赎回款	-1,083,997,184.61	-307,569,018.42	-1,391,566,203.03
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）	888,355,367.19	556,311,392.41	1,444,666,759.60

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：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.2.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

#### 7.4.4 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



中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.5.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	382,614,289.91	2.35%	199,918,801.69	3.63%

###### 7.4.5.1.2 权证交易

注：无。

###### 7.4.5.1.3 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	338,575.38	2.29%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	176,907.86	3.57%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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

务等。

### 7.4.5.2 关联方报酬

#### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	19,247,036.75	22,554,910.75
其中：支付销售机构的客户维护费	2,884,215.94	2,466,997.10

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。

#### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,207,839.44	3,759,151.73

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。

### 7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.5.4.2 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。

### 7.4.5.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	118,876,271.79	1,612,910.05	278,529,777.60

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。

#### 7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.6 期末（2015 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

注：无。

##### 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
600271	航天信息	2015 年 10 月 12 日	重大资产 重组	71.47	未知	未知	7	422.72	500.29	-
600880	博瑞传播	2015 年 9 月 16 日	重大资产 重组	11.37	2016 年 1 月 18 日	8.25	700,000	5,889,185.26	7,959,000.00	-
300038	梅泰诺	2015 年 12 月 16 日	重大资产 重组	56.68	未知	未知	949,000	36,495,738.41	53,789,320.00	-
300366	创意信息	2015 年 12 月 29 日	重大资产 重组	77.70	未知	未知	995,196	39,699,149.01	77,326,729.20	-

注：本基金截至 2015 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。

##### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,025,430,791.38 元，属于第二层次的余额为 139,075,549.49 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 906,701,080.81 元，第二层次 137,323,500.39，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 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	1,164,506,340.87	88.58
	其中：股票	1,164,506,340.87	88.58
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	130,129,827.97	9.90
7	其他各项资产	19,986,105.53	1.52
8	合计	1,314,622,274.37	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	-	-
B	采矿业	33,746,522.42	2.60
C	制造业	541,255,485.39	41.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,757,720.00	0.98
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	82,849,877.64	6.37
G	交通运输、仓储和邮政业	10,308,118.55	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	338,831,690.06	26.07

J	金融业	-	-
K	房地产业	87,377,329.08	6.72
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	16,115,714.73	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	36,043,343.00	2.77
S	综合	5,220,540.00	0.40
	合计	1,164,506,340.87	89.60

### 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	300078	思创医惠	1,607,700	78,455,760.00	6.04
2	300366	创意信息	995,196	77,326,729.20	5.95
3	600734	实达集团	2,935,377	71,388,368.64	5.49
4	002667	鞍重股份	767,912	57,439,817.60	4.42
5	300038	梅泰诺	949,000	53,789,320.00	4.14
6	603636	南威软件	478,308	46,788,088.56	3.60
7	300467	迅游科技	502,580	45,624,212.40	3.51
8	600446	金证股份	787,900	38,756,801.00	2.98
9	000666	经纬纺机	1,218,507	36,616,135.35	2.82
10	600756	浪潮软件	685,600	35,260,408.00	2.71

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	601166	兴业银行	116,705,213.79	8.08
2	002609	捷顺科技	95,962,139.68	6.64

3	601318	中国平安	94,156,954.56	6.52
4	300202	聚龙股份	86,892,827.76	6.01
5	300078	思创医惠	86,691,924.99	6.00
6	600804	鹏博士	83,486,328.03	5.78
7	601098	中南传媒	78,005,325.08	5.40
8	002402	和而泰	76,343,014.90	5.28
9	300136	信维通信	75,732,121.14	5.24
10	600068	葛洲坝	73,625,633.52	5.10
11	300017	网宿科技	71,968,829.57	4.98
12	600999	招商证券	65,474,930.59	4.53
13	000024	招商地产	63,681,623.10	4.41
14	300274	阳光电源	62,215,481.95	4.31
15	000802	北京文化	61,154,363.62	4.23
16	002667	鞍重股份	54,668,187.70	3.78
17	002008	大族激光	53,521,034.30	3.70
18	300467	迅游科技	51,813,997.18	3.59
19	000776	广发证券	51,076,004.14	3.54
20	300011	鼎汉技术	50,598,019.98	3.50
21	300188	美亚柏科	48,676,840.45	3.37
22	600734	实达集团	47,908,575.55	3.32
23	601288	农业银行	47,581,451.00	3.29
24	600303	曙光股份	47,060,961.42	3.26
25	600690	青岛海尔	46,779,858.48	3.24
26	002153	石基信息	46,136,967.52	3.19
27	600699	均胜电子	45,739,904.50	3.17
28	000697	炼石有色	45,671,803.03	3.16
29	000100	TCL 集团	45,586,989.09	3.16
30	600885	宏发股份	45,114,121.45	3.12
31	600373	中文传媒	45,060,688.73	3.12
32	300292	吴通控股	44,808,168.72	3.10
33	601985	中国核电	44,684,252.05	3.09
34	600485	信威集团	43,815,086.11	3.03
35	600030	中信证券	42,892,991.00	2.97
36	603636	南威软件	42,863,002.76	2.97
37	300366	创意信息	42,647,702.26	2.95
38	002141	蓉胜超微	42,194,418.03	2.92

39	002668	奥马电器	42,036,456.88	2.91
40	002466	天齐锂业	41,895,975.92	2.90
41	000488	晨鸣纸业	41,797,657.06	2.89
42	002354	天神娱乐	41,427,858.00	2.87
43	000892	*ST 星美	40,042,611.38	2.77
44	600198	大唐电信	39,954,185.04	2.77
45	000666	经纬纺机	39,617,073.82	2.74
46	600406	国电南瑞	39,596,934.40	2.74
47	000543	皖能电力	39,443,519.31	2.73
48	000070	特发信息	39,103,790.79	2.71
49	600000	浦发银行	38,639,692.77	2.67
50	002121	科陆电子	38,142,768.59	2.64
51	300059	东方财富	37,068,679.11	2.57
52	600585	海螺水泥	36,753,082.40	2.54
53	300431	暴风科技	36,624,949.62	2.54
54	300038	梅泰诺	36,495,738.41	2.53
55	002312	三泰控股	36,456,954.16	2.52
56	600446	金证股份	36,211,123.44	2.51
57	000043	中航地产	36,176,860.24	2.50
58	002081	金螳螂	35,168,839.52	2.43
59	001979	招商蛇口	35,126,698.18	2.43
60	600756	浪潮软件	34,951,861.85	2.42
61	002065	东华软件	34,830,669.07	2.41
62	300302	同有科技	34,784,599.60	2.41
63	000831	五矿稀土	34,697,707.93	2.40
64	000681	视觉中国	34,234,028.72	2.37
65	601601	中国太保	34,159,451.48	2.36
66	600519	贵州茅台	34,113,163.08	2.36
67	600376	首开股份	34,088,868.05	2.36
68	300226	上海钢联	33,969,962.38	2.35
69	600855	航天长峰	33,899,204.44	2.35
70	002256	彩虹精化	32,704,466.20	2.26
71	300359	全通教育	32,618,816.70	2.26
72	601555	东吴证券	32,007,675.07	2.22
73	002681	奋达科技	31,012,646.08	2.15
74	601857	中国石油	30,915,793.51	2.14



75	002701	奥瑞金	30,313,542.13	2.10
76	000429	粤高速 A	30,219,750.11	2.09
77	002042	华孚色纺	29,710,413.41	2.06
78	002375	亚厦股份	29,511,881.44	2.04
79	600886	国投电力	29,509,392.06	2.04
80	000895	双汇发展	29,036,053.29	2.01
81	300252	金信诺	28,968,524.00	2.01

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	170,288,053.06	11.79
2	601166	兴业银行	160,446,033.60	11.11
3	000024	招商地产	126,453,127.16	8.75
4	002609	捷顺科技	108,619,719.19	7.52
5	300070	碧水源	95,463,645.31	6.61
6	300202	聚龙股份	86,007,360.74	5.95
7	300136	信维通信	85,636,939.78	5.93
8	601628	中国人寿	84,838,440.21	5.87
9	600804	鹏博士	84,680,107.21	5.86
10	002402	和而泰	84,327,108.33	5.84
11	600000	浦发银行	78,261,555.07	5.42
12	601601	中国太保	78,051,176.31	5.40
13	601098	中南传媒	76,640,018.49	5.31
14	600887	伊利股份	71,914,697.77	4.98
15	600373	中文传媒	71,026,301.42	4.92
16	300017	网宿科技	70,739,744.92	4.90
17	002183	怡亚通	70,680,193.80	4.89
18	600068	葛洲坝	68,074,417.43	4.71
19	600703	三安光电	66,866,871.71	4.63
20	000802	北京文化	64,991,294.00	4.50
21	002466	天齐锂业	61,025,289.86	4.22
22	002121	科陆电子	59,483,296.19	4.12
23	600446	金证股份	58,470,398.70	4.05

24	600999	招商证券	57,115,924.18	3.95
25	300274	阳光电源	56,481,333.59	3.91
26	002008	大族激光	55,687,882.78	3.85
27	002465	海格通信	53,764,648.16	3.72
28	300188	美亚柏科	53,061,927.92	3.67
29	300011	鼎汉技术	51,910,973.65	3.59
30	002153	石基信息	50,966,137.24	3.53
31	300292	吴通控股	50,374,951.96	3.49
32	000776	广发证券	50,147,510.51	3.47
33	600030	中信证券	49,879,233.93	3.45
34	000892	*ST 星美	49,679,979.60	3.44
35	600885	宏发股份	48,387,838.11	3.35
36	002271	东方雨虹	48,132,312.79	3.33
37	600309	万华化学	47,468,551.27	3.29
38	601288	农业银行	47,446,937.43	3.28
39	600303	曙光股份	47,411,613.55	3.28
40	002152	广电运通	47,318,923.55	3.28
41	002285	世联行	46,901,404.14	3.25
42	002141	蓉胜超微	45,929,041.30	3.18
43	601985	中国核电	45,322,758.66	3.14
44	002542	中化岩土	45,168,909.59	3.13
45	300332	天壕环境	44,876,971.93	3.11
46	600690	青岛海尔	44,802,879.27	3.10
47	300072	三聚环保	43,828,005.39	3.03
48	000100	TCL 集团	43,747,739.70	3.03
49	600198	大唐电信	43,690,447.75	3.02
50	002375	亚厦股份	42,818,195.09	2.96
51	300322	硕贝德	42,442,874.72	2.94
52	600699	均胜电子	42,287,914.96	2.93
53	000488	晨鸣纸业	41,821,061.83	2.89
54	600406	国电南瑞	41,650,589.13	2.88
55	002354	天神娱乐	40,108,033.16	2.78
56	000070	特发信息	39,595,045.61	2.74
57	002701	奥瑞金	39,063,471.54	2.70
58	600584	长电科技	38,600,943.21	2.67
59	600522	中天科技	38,058,984.80	2.63
60	002280	联络互动	37,647,272.79	2.61
61	300009	安科生物	37,488,811.90	2.59

62	002312	三泰控股	36,918,176.47	2.56
63	600855	航天长峰	36,772,741.25	2.55
64	002657	中科金财	35,865,571.91	2.48
65	300059	东方财富	35,824,577.20	2.48
66	002668	奥马电器	35,534,078.01	2.46
67	601555	东吴证券	35,190,018.39	2.44
68	002241	歌尔声学	34,864,496.91	2.41
69	600519	贵州茅台	34,728,071.89	2.40
70	002230	科大讯飞	34,094,996.55	2.36
71	600585	海螺水泥	33,629,458.13	2.33
72	002065	东华软件	32,916,977.02	2.28
73	002268	卫士通	32,741,811.27	2.27
74	300431	暴风科技	31,673,770.96	2.19
75	000831	五矿稀土	31,421,630.79	2.18
76	002256	彩虹精化	31,417,134.17	2.17
77	300359	全通教育	31,341,625.57	2.17
78	002325	洪涛股份	31,237,958.92	2.16
79	002042	华孚色纺	31,063,022.39	2.15
80	300226	上海钢联	31,033,134.15	2.15
81	601857	中国石油	30,983,183.30	2.14
82	300065	海兰信	30,800,168.91	2.13
83	002396	星网锐捷	30,626,458.90	2.12
84	000651	格力电器	30,502,869.51	2.11
85	300397	天和防务	30,340,322.22	2.10
86	002407	多氟多	30,326,022.75	2.10
87	000750	国海证券	30,244,118.00	2.09
88	600376	首开股份	30,046,561.38	2.08
89	000429	粤高速 A	29,834,851.36	2.07
90	600886	国投电力	29,717,368.90	2.06
91	002681	奋达科技	29,603,688.84	2.05
92	002094	青岛金王	29,161,583.09	2.02

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	7,792,203,918.86
卖出股票收入（成交）总额	8,477,250,162.44

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

5.8.2 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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,583,083.51
2	应收证券清算款	15,946,601.35
3	应收股利	-
4	应收利息	41,571.13

5	应收申购款	2,414,849.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,986,105.53

#### 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	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	300366	创意信息	77,326,729.20	5.95	重大资产重组
2	300038	梅泰诺	53,789,320.00	4.14	重大资产重组

## §9 基金份额持有人信息

### 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
60,864	8,773.18	12,429,322.58	2.33%	521,541,613.27	97.67%

### 9.2 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	1,912,523.83	0.3582%

### 9.3 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	50~100

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年6月18日）基金份额总额	1,139,765,865.76
本报告期期初基金份额总额	888,355,367.19
本报告期基金总申购份额	999,125,512.61
减:本报告期基金总赎回份额	1,353,509,943.95
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	533,970,935.85

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

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。

### 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

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所，本报告期应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91,000.00元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为8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

### 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	
国信证券	1	3,525,673,054.39	21.67%	3,157,142.61	21.38%	-
信达证券	1	2,660,677,088.02	16.35%	2,461,975.58	16.67%	-
银河证券	2	2,567,717,594.94	15.78%	2,322,294.57	15.73%	-
招商证券	1	1,672,917,335.82	10.28%	1,535,954.45	10.40%	-
上海证券	1	1,588,899,499.10	9.77%	1,423,788.81	9.64%	-
中信建投	2	1,222,069,693.14	7.51%	1,111,321.58	7.53%	-
广发证券	2	853,100,855.57	5.24%	777,431.90	5.27%	-
华安证券	1	754,658,589.35	4.64%	687,039.79	4.65%	-
海通证券	1	619,908,619.23	3.81%	564,693.93	3.82%	-
华泰证券	2	382,614,289.91	2.35%	338,575.38	2.29%	-
东吴证券	1	197,356,872.96	1.21%	183,797.96	1.24%	-
西部证券	1	119,552,195.94	0.73%	108,836.88	0.74%	-
申万宏源	2	104,308,392.93	0.64%	92,302.06	0.63%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中泰证券	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
国信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况 无。

2、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

- 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。