

# 南方稳健成长证券投资基金 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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 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

基金简称	南方稳健成长混合
基金主代码	202001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2001 年 9 月 28 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	1,720,307,609.31 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“南方稳健”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为稳健成长型基金，在控制风险并保持基金投资组合良好流动性的前提下，力求为投资者提供长期稳定的资本利得。
投资策略	本基金秉承价值投资和稳健投资的理念，通过深入的调查研究，挖掘上市公司的价值，寻求价值被低估的证券，采取低风险适度收益的配比原则，通过科学的组合投资，降低投资风险，以中长期投资为主，追求基金资产的长期稳定增值。

### 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
--------------------	---

址	
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	1,463,852,556.38	544,381,141.50	231,443,218.26
本期利润	1,372,495,968.38	662,890,285.58	207,604,728.60
加权平均基金份额本期利润	0.5987	0.1663	0.0449
本期基金份额净值增长率	42.73%	21.07%	5.35%
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	0.4323	0.0227	-0.1553
期末基金资产净值	2,464,046,179.66	3,489,092,219.55	3,654,556,895.53
期末基金份额净值	1.4323	1.0227	0.8447

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

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

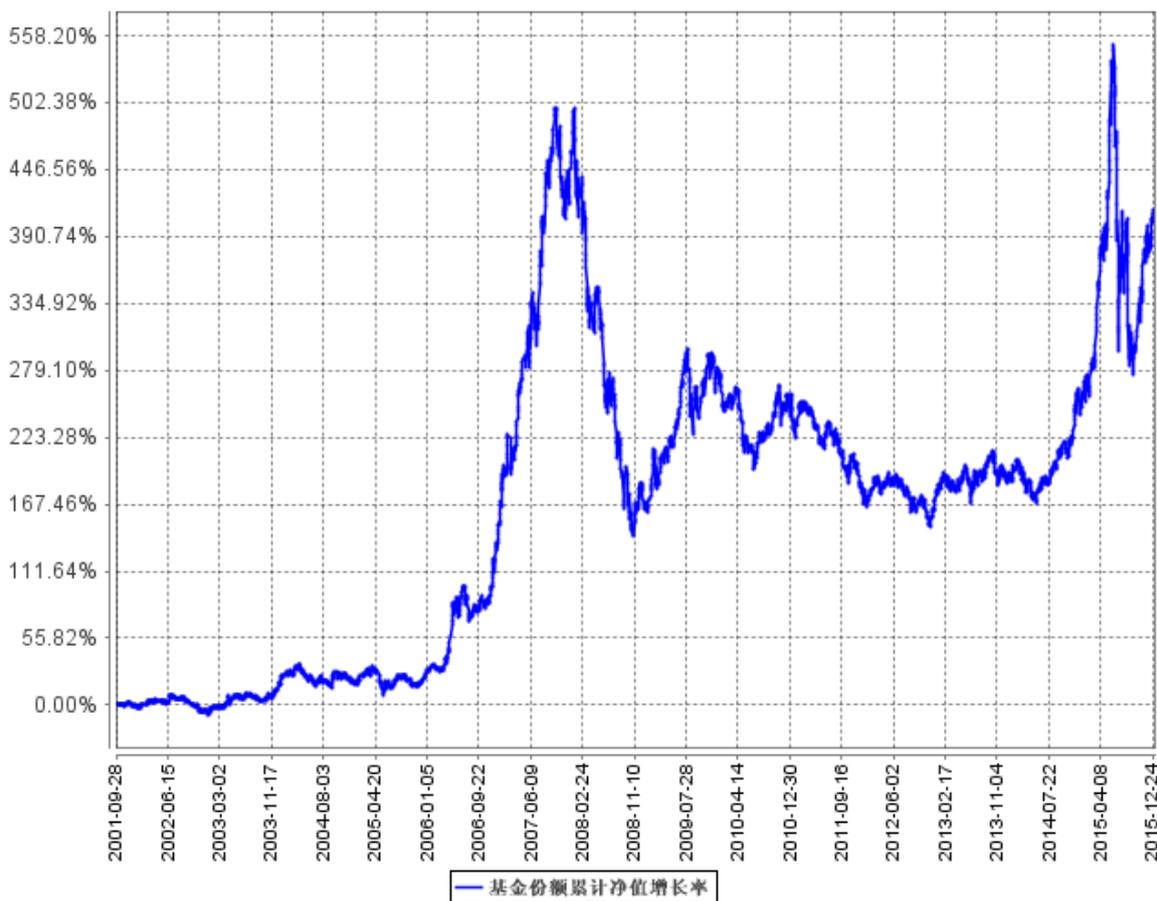
#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	27.70%	1.59%	0.00%	0.00%	27.70%	1.59%
过去六个月	0.43%	2.64%	0.00%	0.00%	0.43%	2.64%
过去一年	42.73%	2.35%	0.00%	0.00%	42.73%	2.35%
过去三年	82.06%	1.59%	0.00%	0.00%	82.06%	1.59%
过去五年	43.13%	1.35%	0.00%	0.00%	43.13%	1.35%
自基金合同生效起至今	406.88%	1.32%	0.00%	0.00%	406.88%	1.32%

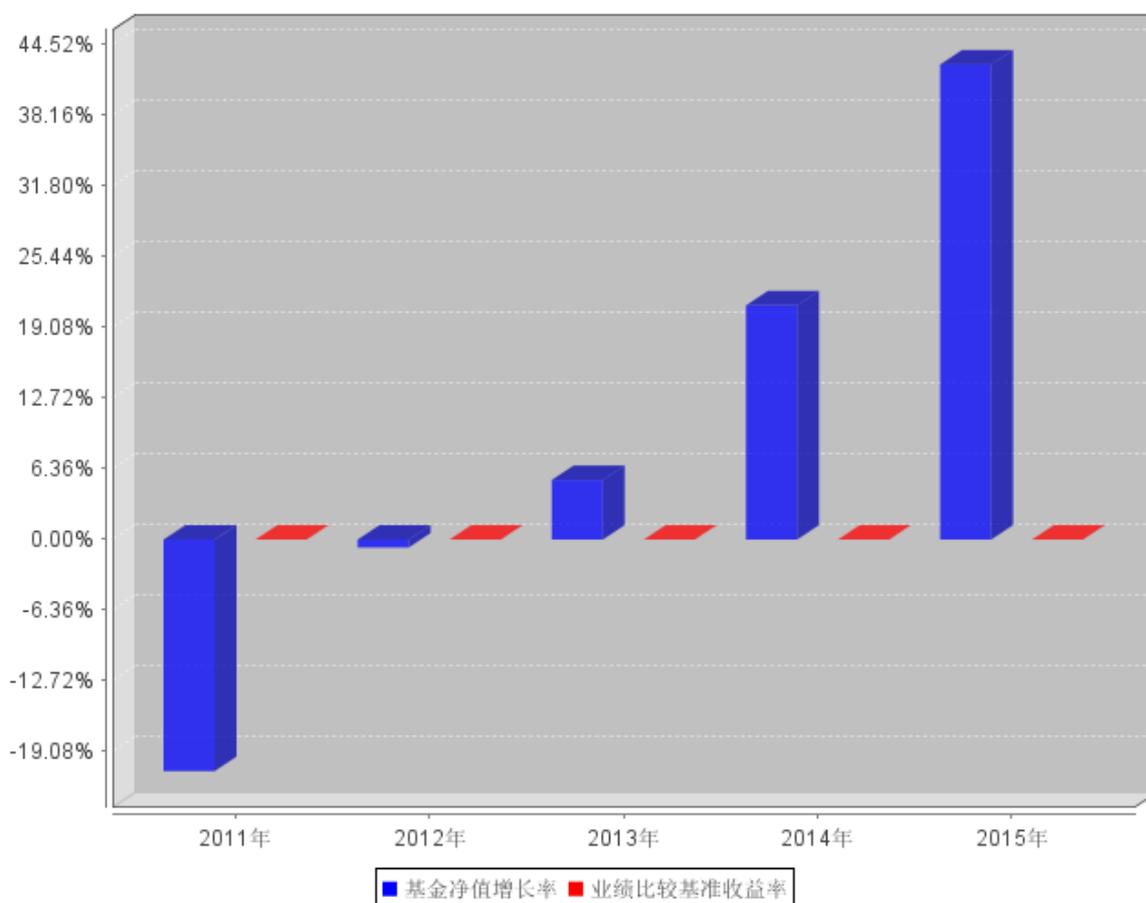
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 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	0.2000	22,388,367.87	44,025,252.00	66,413,619.87	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	0.2000	22,388,367.87	44,025,252.00	66,413,619.87	

## § 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		
应帅	本基金基金经理	2012 年 11 月 23 日	-	14 年	北大光华管理学院管理学硕士，具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员，2007 年加入南方基金，2007 年 5 月至 2009 年 2 月，任南方宝元基金经理；2007 年 5 月至 2012 年 11 月，任南方成份基金经理；2010 年 12 月至今，任南方宝元基金经理；2012 年 11 月至今，任南方稳健基金经理；2012 年 11 月至今，任南稳贰号基金经理。
李源海	本基金基金经理	2010 年 7 月 15 日	2015 年 2 月 16 日	14 年	管理学博士，具有基金从业资格。曾任职于中国银行深圳分行、湘财证券有限责任公司投资银行部及证券投资部；2002 年起进入基金行业，历任万家基金管理有限公司（原天同基金管理有限公司）研究部高级经理、基金管理部基金经理；2004 年 9 月至 2005 年 10 月任万家增强收益债券型证券投资基金（原天同保本增值证券投资基金）基金经理；2006 年 7 月至 2007 年 7 月任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理；2006 年 2 月至 2009 年 8 月，任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理；2008 年 7 月至 2009 年 8 月，任申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金经理。2009 年 8 月，加入南方基金，任职于产品开发部；2010 年 1 月至 2015 年 2 月，担任南方基金投资部副总监、南方积配基金经理；2010 年 7 月至 2015 年 2 月，任南方稳健、南稳贰号基金经理。
蔡望鹏	本基金基金经理助理	2013 年 6 月 20 日	2015 年 1 月 13 日	7 年	清华大学固体力学专业硕士学历，具有基金从业资格。2008 年 4 月至 2013 年 2 月，担任博时基金管理有限公司机械行业研究员；2013 年 2 月加入南方基金，担任南方稳健、南方稳健二号的基金经理助理；2015 年 1 月至今，任南方积配基金经理；2015 年

					7 月至今，任南方中国梦基金经理。
方健	本基金基金经理助理	2015 年 3 月 25 日	2015 年 5 月 26 日	3 年	清华大学材料科学与工程专业博士，具有基金从业资格，2012 年 7 月加入南方基金，任研究部助理研究员，负责中小市值的行业研究；2015 年 2 月至 5 月，担任南方盛元、南方产业活力基金经理助理。2015 年 3 月至 7 月，担任南方稳健、南稳贰号、南方宝元基金经理助理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方稳健成长证券投资基金合同》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，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下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年中国股票市场波荡起伏，上半年在资金牛、改革牛以及互联网+的推动下，A股市场迎来了巨大的涨幅，沪深300最大上涨幅度超过50%，创业板指数最大上涨幅度超过170%。然而6月下旬以来中国股票市场出现了前所未有的挑战，持续大幅震荡下跌到接近8月底，沪深300和创业板跌幅都超过40%。本基金年初以来对资本市场比较乐观，仓位一直高居不下，在上半年获得了较好的收益，但随之而来的市场调整让基金净值遭受较大损失。本基金上半年主要配置在计算机、传媒等新兴产业以及电力、机械等传统行业，在三季度市场调整过程中，大幅度降低了计算机板块的配置，同时加大了新能源汽车、转型股、地产股的配置，在年底的反弹中基金也获得了较好的投资收益。本基金将继续采取自下而上的选股策略，同时将更加注重择时策略，争取获得较好的绝对收益和相对收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年沪深300指数增长率为5.58%，基金净值增长率为42.73%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年 GDP 增速与过往相比尽管有所降低，但仍处于较高水平。展望 2016 年，随着国企改革深入、货币政策和财政政策的适度宽松，经济增速预计仍可维持较好水平。由于全球经济局势有所反复以及人民币汇率波动调整，预计中国 A 股市场会震荡加剧。

## 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合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作，制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度，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，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、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。

#### 4.8 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：基金收益分配比例按有关规定制定；投资者可以选择现金分红方式或分红再投资的分红方式，以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准，投资者选择分红的默认方式为现金分红；基金投资当年亏损，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；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值；每一基金单位享有同等分配权。

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 19 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 0.20 元）；本报告期内 2015 年 1 月 19 日已分配数（每 10 份基金份额派发红利 0.20 元）为以往年度收益分配。

#### 4.10 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稳健成长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，南方稳健成长证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方稳健成长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，南方稳健成长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 66,413,619.87 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稳健成长证券投资基金 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 2015 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(2016)第 21264 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方稳健成长证券投资基金

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	78,461,551.08	86,773,275.34
结算备付金	9,640,454.86	10,183,758.80
存出保证金	1,766,265.95	1,202,192.78
交易性金融资产	2,385,171,906.05	3,445,272,365.70
其中：股票投资	1,880,279,848.35	2,697,628,397.47
基金投资	-	-
债券投资	504,892,057.70	747,643,968.23
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	-	-
应收证券清算款	39,039,487.49	4,008,158.90
应收利息	10,376,419.72	13,360,155.66
应收股利	-	-
应收申购款	302,777.81	135,723.45
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,524,758,862.96	3,560,935,630.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2015年12月31日</b>	<b>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	48,228,792.73	37,782,930.35
应付赎回款	3,360,291.12	17,867,828.28
应付管理人报酬	3,092,810.18	4,573,791.62
应付托管费	515,468.35	762,298.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,274,686.31	10,476,222.16
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	240,634.61	380,340.07
负债合计	60,712,683.30	71,843,411.08
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,720,307,609.31	3,411,486,966.21
未分配利润	743,738,570.35	77,605,253.34
所有者权益合计	2,464,046,179.66	3,489,092,219.55
负债和所有者权益总计	2,524,758,862.96	3,560,935,630.63

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4323 元，基金份额总额

1,720,307,609.31 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方稳健成长证券投资基金

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>	1,466,204,114.26	749,388,284.50
1. 利息收入	27,195,883.24	30,431,145.76
其中：存款利息收入	993,606.47	1,492,810.84
债券利息收入	26,002,035.63	28,193,458.84
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	200,241.14	744,876.08
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,527,040,535.64	599,309,854.74
其中：股票投资收益	1,512,937,430.98	574,314,392.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,732,948.50	-8,477,505.79
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	12,370,156.16	33,472,967.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-91,356,588.00	118,509,144.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,324,283.38	1,138,139.92
<b>减：二、费用</b>	93,708,145.88	86,497,998.92
1. 管理人报酬	43,919,742.83	51,732,556.78
2. 托管费	7,319,957.09	8,622,092.87
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	42,037,840.82	25,303,994.48
5. 利息支出	-	403,695.39
其中：卖出回购金融资产支出	-	403,695.39
6. 其他费用	430,605.14	435,659.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	1,372,495,968.38	662,890,285.58
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	1,372,495,968.38	662,890,285.58

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方稳健成长证券投资基金

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）	3,411,486,966.21	77,605,253.34	3,489,092,219.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,372,495,968.38	1,372,495,968.38
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）	-1,691,179,356.90	-639,949,031.50	-2,331,128,388.40
其中：1. 基金申购款	253,491,609.29	74,685,994.33	328,177,603.62
2. 基金赎回款	-1,944,670,966.19	-714,635,025.83	-2,659,305,992.02
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）	-	-66,413,619.87	-66,413,619.87
五、期末所有者权益（基金净值）	1,720,307,609.31	743,738,570.35	2,464,046,179.66
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）	4,326,569,663.50	-672,012,767.97	3,654,556,895.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	662,890,285.58	662,890,285.58
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）	-915,082,697.29	86,727,735.73	-828,354,961.56
其中：1. 基金申购款	91,852,976.41	-9,766,520.03	82,086,456.38
2. 基金赎回款	-1,006,935,673.70	96,494,255.76	-910,441,417.94
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）	3,411,486,966.21	77,605,253.34	3,489,092,219.55
-----------------	------------------	---------------	------------------

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 重要会计政策和会计估计

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.1.2 会计估计变更的说明

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。

##### 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[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。

### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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。

### 7.4.4 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 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	-	-	386,542,276.72	0.24%

##### 7.4.4.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 7.4.4.1.5 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	-	-	-	-
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	342,053.20	2.32%	342,053.20	3.27%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 7.4.4.2 关联方报酬

## 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	43,919,742.83
其中：支付销售机构的客户维护费	706,244.45	752,549.42

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

## 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	7,319,957.09	8,622,092.87
----------------	--------------	--------------

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

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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
中国工商银行	-	57,513,784.11	-	-	-	-

#### 7.4.4.4 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

注：本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 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：本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

#### 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 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	78,461,551.08	791,335.28	86,773,275.34	1,373,176.61

注：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**

注：本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

**7.4.4.7 其他关联交易事项的说明**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.5 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.5.2 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
300038	梅泰诺	2015 年 12 月 15 日	重大资产重组	56.68	-	-	580,924	23,224,272.17	32,926,772.32	-
600645	中源协和	2015 年 12 月 29 日	重大事项未公告	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	379,952	25,487,096.87	24,700,679.52	-
600354	敦煌种业	2015 年 12 月 14 日	重大资产重组	9.88	2016 年 1 月 19 日	8.89	700,000	10,057,775.27	6,916,000.00	-
600153	建发股份	-	重大资产重组	14.69	-	-	85	1,264.53	1,248.65	-
300028	金亚科技	2015 年 9 月 8 日	重大事项	11.42	-	-	100	3,410.50	1,142.00	-

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。

**7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本报告期末及上年度可比期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.6 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 1,815,734,005.86 元，属于第二层次的余额为 569,436,758.19 元，属于第三层次的余额为 1,142.00 元(2014 年 12 月 31 日：第一层次 2,629,447,994.68 元，第二层次 815,824,371.02 元，无第三层次)。

##### (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。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)，本基金于 2015 年 3 月 16 日起改为采用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(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

	<u>交易性金融资产</u>
	<u>——股票投资</u>
<u>2015 年 1 月 1 日</u>	-
<u>购买</u>	-
<u>出售</u>	-
<u>转入第三层次</u>	<u>1,142.00</u>

转出第三层次	=
当期利得或损失总额	=
——计入损益的利得或损失	=
2015 年 12 月 31 日	<u>1,142.00</u>
2015 年 12 月 31 日仍持有的	
资产计入 2015 年度损益的未	
实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	<u>-2,268.50</u>

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动收益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照市盈率定价模型确定。

(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	1,880,279,848.35	74.47
	其中：股票	1,880,279,848.35	74.47
2	固定收益投资	504,892,057.70	20.00
	其中：债券	504,892,057.70	20.00
	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	88,102,005.94	3.49
7	其他各项资产	51,484,950.97	2.04
8	合计	2,524,758,862.96	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,916,000.00	0.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,208,963,910.90	49.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,739,000.00	1.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	119,822,171.90	4.86
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	89.67	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,714,540.89	3.72
J	金融业	193,491,000.00	7.85
K	房地产业	181,866,455.47	7.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	24,700,679.52	1.00
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,066,000.00	0.94
S	综合	-	-
	合计	1,880,279,848.35	76.31

## 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

## 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	600185	格力地产	4,055,933	86,148,016.92	3.50
2	600563	法拉电子	2,069,827	86,125,501.47	3.50
3	000638	万方发展	2,587,243	79,040,273.65	3.21
4	600303	曙光股份	5,042,300	77,399,305.00	3.14
5	002094	青岛金王	2,479,955	77,250,598.25	3.14
6	002117	东港股份	1,584,864	72,935,441.28	2.96
7	601166	兴业银行	4,000,000	68,280,000.00	2.77
8	300128	锦富新材	2,619,996	66,390,698.64	2.69
9	002466	天齐锂业	449,794	63,308,505.50	2.57
10	601988	中国银行	15,000,000	60,150,000.00	2.44

## 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	288,315,966.92	8.26
2	600894	广日股份	187,907,258.75	5.39
3	601098	中南传媒	156,307,674.75	4.48
4	002094	青岛金王	154,591,515.34	4.43
5	600780	通宝能源	150,464,935.77	4.31
6	000543	皖能电力	150,238,010.03	4.31
7	600030	中信证券	145,356,288.98	4.17
8	600185	格力地产	132,079,119.58	3.79

9	603008	喜临门	121,825,075.52	3.49
10	002609	捷顺科技	114,363,407.19	3.28
11	002366	台海核电	109,914,880.79	3.15
12	600000	浦发银行	109,458,963.61	3.14
13	002550	千红制药	109,251,777.87	3.13
14	000030	富奥股份	108,183,451.97	3.10
15	600068	葛洲坝	100,255,410.26	2.87
16	600761	安徽合力	98,094,798.48	2.81
17	002236	大华股份	98,060,148.75	2.81
18	002429	兆驰股份	95,317,896.34	2.73
19	002167	东方锆业	93,659,986.83	2.68
20	000001	平安银行	93,009,517.47	2.67
21	600373	中文传媒	89,530,562.12	2.57
22	002367	康力电梯	88,585,080.79	2.54
23	600897	厦门空港	85,489,677.79	2.45
24	000732	泰禾集团	81,567,675.07	2.34
25	002055	得润电子	81,495,052.58	2.34
26	002076	雪莱特	81,313,836.11	2.33
27	000776	广发证券	81,259,818.83	2.33
28	600563	法拉电子	79,093,171.31	2.27
29	002191	劲嘉股份	77,675,604.24	2.23
30	002318	久立特材	77,266,058.00	2.21
31	000599	青岛双星	76,952,243.06	2.21
32	300011	鼎汉技术	76,438,379.61	2.19
33	002315	焦点科技	76,192,926.74	2.18
34	601318	中国平安	75,423,161.06	2.16
35	000039	中集集团	71,758,684.97	2.06
36	603898	好莱客	71,426,887.78	2.05
37	601818	光大银行	71,135,539.10	2.04
38	601939	建设银行	70,931,804.80	2.03

#### 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	000543	皖能电力	319,596,552.65	9.16
2	601166	兴业银行	309,595,680.69	8.87
3	601318	中国平安	240,098,953.62	6.88
4	600894	广日股份	237,055,418.26	6.79
5	600446	金证股份	207,648,202.49	5.95
6	002055	得润电子	206,419,111.85	5.92
7	002366	台海核电	187,965,953.30	5.39
8	600780	通宝能源	178,560,190.23	5.12
9	601098	中南传媒	164,618,492.21	4.72
10	600000	浦发银行	148,476,347.52	4.26
11	002609	捷顺科技	144,215,218.89	4.13
12	601818	光大银行	136,840,033.92	3.92
13	002236	大华股份	134,871,274.26	3.87
14	300070	碧水源	127,304,574.16	3.65
15	600373	中文传媒	122,021,529.70	3.50
16	002550	千红制药	118,297,736.70	3.39
17	600030	中信证券	115,123,384.55	3.30
18	002191	劲嘉股份	112,781,081.19	3.23
19	600570	恒生电子	112,517,010.90	3.22
20	601628	中国人寿	111,199,019.33	3.19
21	000030	富奥股份	106,846,362.00	3.06
22	002315	焦点科技	106,319,369.49	3.05
23	002325	洪涛股份	104,875,789.29	3.01
24	000625	长安汽车	102,578,846.33	2.94
25	600068	葛洲坝	99,041,749.10	2.84
26	600466	蓝光发展	98,469,954.75	2.82
27	000001	平安银行	98,299,798.09	2.82
28	000732	泰禾集团	96,521,654.81	2.77
29	002167	东方锆业	93,974,399.18	2.69
30	002094	青岛金王	92,988,425.46	2.67
31	601021	春秋航空	91,436,574.59	2.62
32	600036	招商银行	90,562,771.28	2.60
33	600897	厦门空港	88,992,983.88	2.55
34	002072	凯瑞德	84,416,680.75	2.42
35	000776	广发证券	80,374,822.66	2.30
36	300248	新开普	79,208,436.66	2.27
37	000039	中集集团	78,840,009.31	2.26
38	000652	泰达股份	78,580,253.49	2.25

39	002367	康力电梯	78,302,834.47	2.24
40	000599	青岛双星	77,767,858.75	2.23
41	600594	益佰制药	76,513,560.15	2.19
42	300011	鼎汉技术	76,212,598.99	2.18
43	600703	三安光电	76,071,804.71	2.18
44	300336	新文化	75,934,480.75	2.18
45	601009	南京银行	73,834,342.38	2.12
46	601939	建设银行	73,548,860.97	2.11
47	600742	一汽富维	73,236,491.76	2.10
48	600697	欧亚集团	72,041,701.74	2.06
49	300352	北信源	71,884,806.85	2.06
50	603898	好莱客	71,112,128.26	2.04
51	603001	奥康国际	70,983,301.93	2.03
52	600029	南方航空	70,550,309.06	2.02
53	600115	东方航空	70,147,584.05	2.01
54	002630	华西能源	70,100,578.39	2.01

#### 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	12,456,054,887.14
卖出股票收入（成交）总额	14,683,034,363.46

#### 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	77,134,648.60	3.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	427,757,409.10	17.36
	其中：政策性金融债	427,757,409.10	17.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	504,892,057.70	20.49

## 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	080220	08 国开 20	2,100,000	214,557,000.00	8.71
2	018002	国开 1302	708,000	77,618,040.00	3.15
3	019509	15 国债 09	490,000	49,107,800.00	1.99
4	018001	国开 1301	436,910	43,695,369.10	1.77
5	110412	11 农发 12	400,000	40,408,000.00	1.64

## 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

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。

## 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

### 8.10.1 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。

### 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	1,766,265.95
2	应收证券清算款	39,039,487.49
3	应收股利	-
4	应收利息	10,376,419.72
5	应收申购款	302,777.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,484,950.97

### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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
106,609	16,136.61	11,511,744.27	0.67%	1,708,795,865.04	99.33%

### 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	896,953.31	0.0521%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2001年9月28日）基金份额总额	3,488,938,200.00
本报告期期初基金份额总额	3,411,486,966.21
本报告期基金总申购份额	253,491,609.29
减：本报告期基金总赎回份额	1,944,670,966.19
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	1,720,307,609.31

## § 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

本报告期内本基金未更换会计师事务所，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 92,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 15 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	
招商证券		14,953,310,445.19	18.25%	4,432,573.85	18.10%	-
中泰证券(原齐鲁证券)		13,540,177,742.08	13.04%	3,176,885.19	12.98%	-

申银万国	12,710,229,903.65	9.99%	2,398,284.23	9.80%	-
中信证券	22,685,522,001.45	9.90%	2,424,651.04	9.90%	-
国泰君安	12,089,621,849.45	7.70%	1,864,291.94	7.61%	-
银河证券	11,576,565,565.79	5.81%	1,435,018.16	5.86%	-
财达证券	11,515,566,673.19	5.58%	1,393,323.57	5.69%	-
方正证券	11,502,308,351.07	5.54%	1,387,928.63	5.67%	-
东兴证券	11,486,205,777.16	5.48%	1,315,144.75	5.37%	-
长城证券	11,409,648,432.37	5.19%	1,312,750.91	5.36%	-
海通证券	11,287,136,904.30	4.74%	1,171,745.02	4.79%	-
东方证券	1 910,166,911.04	3.35%	829,811.60	3.39%	-
国金证券	1 879,488,294.13	3.24%	800,652.11	3.27%	-
东海证券	1 308,740,736.48	1.14%	281,141.65	1.15%	-
西部证券	1 284,335,253.25	1.05%	258,854.23	1.06%	-
广发证券	1 -	-	-	-	-
兴业证券	1 -	-	-	-	-
山西证券	1 -	-	-	-	-
华泰证券	2 -	-	-	-	-
华林证券	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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券（原齐鲁证券）	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	42,391,946.70	7.43%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	277,418,776.30	48.61%	-	-	-	-
财达证券	10,698,789.50	1.87%	-	-	-	-
方正证券	72,072,893.50	12.63%	180,000,000.00	58.06%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	53,028,386.40	9.29%	-	-	-	-

海通证券	61,426,745.70	10.76%	-	-	-	-
东方证券	-	-	50,000,000.00	16.13%	-	-
国金证券	31,998,610.00	5.61%	-	-	-	-
东海证券	18,831,982.30	3.30%	-	-	-	-
西部证券	2,884,019.00	0.51%	80,000,000.00	25.81%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、本期新增 3 家证券公司的 3 个席位：方正证券有限责任公司（上海席位）、招商证券股份有限公司（深圳席位）、中信证券股份有限公司（上海席位）。

#### 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专用交易席位的选择标准和程序：

##### 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席位：

- (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。