

南方策略优化混合型证券投资基金 2015 年年度报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	56
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.....	56

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.....	56
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.....	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
8.12 投资组合报告附注.....	56
§9 基金份额持有人信息.....	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§10 开放式基金份额变动.....	57
§11 重大事件揭示.....	58
11.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
11.4 基金投资策略的改变.....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
11.8 其他重大事件.....	60
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方策略优化混合型证券投资基金
基金简称	南方策略优化混合
基金主代码	202019
前端交易代码	202019
后端交易代码	202020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月30日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	300,223,083.71份

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	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555

传真	0755-82763889	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	中国深圳深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	中国深圳深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	吴万善	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦塔楼31-33层

§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	302,506,084.69	94,043,056.98	-7,981,417.25
本期利润	240,933,392.17	217,210,652.65	-18,097,981.93
加权平均基金份额本期利润	0.5914	0.3079	-0.0210
本期加权平均净值利润率	48.44%	43.34%	-3.22%
本期基金份额净值增长率	62.43%	48.40%	-3.69%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	112,359,112.58	-131,458,890.12	-289,244,895.93
期末可供分配基金份额利润	0.3743	-0.1783	-0.3736
期末基金资产净值	452,965,216.82	684,795,417.97	484,866,015.76
期末基金份额净值	1.509	0.929	0.626
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	53.90%	-5.25%	-36.16%

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。

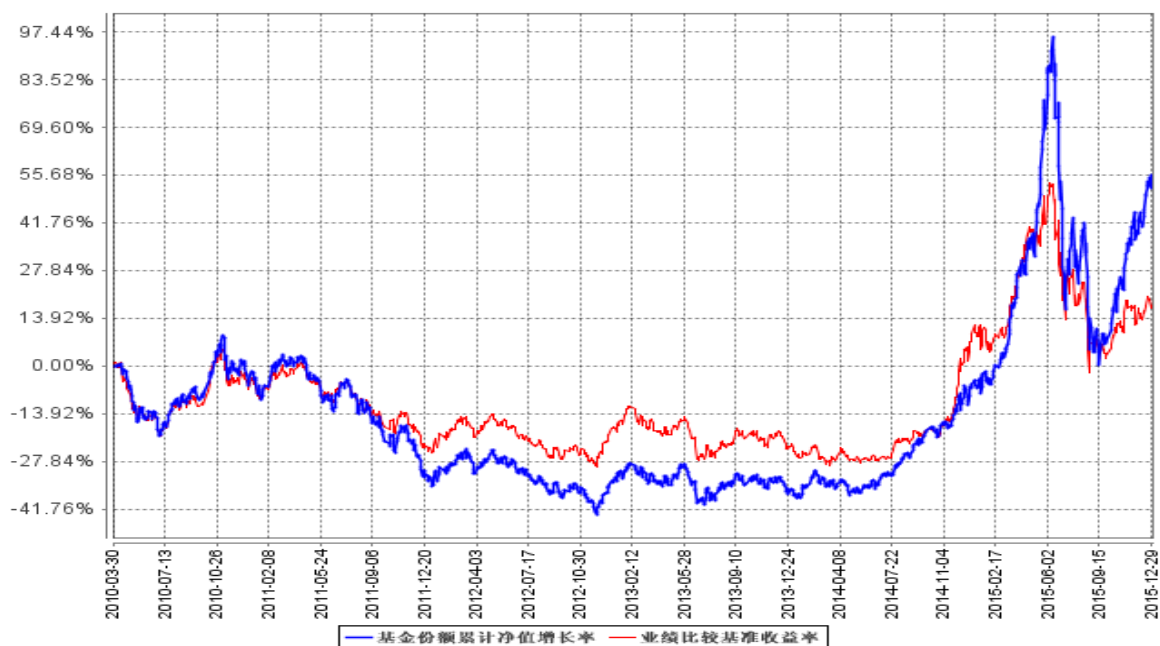
3.2 基金净值表现

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	43.58%	1.83%	13.57%	1.34%	30.01%	0.49%
过去六个月	0.13%	2.77%	-12.31%	2.14%	12.44%	0.63%
过去一年	62.43%	2.46%	6.98%	1.99%	55.45%	0.47%
过去三年	132.15%	1.73%	43.01%	1.43%	89.14%	0.30%
过去五年	58.33%	1.56%	22.97%	1.29%	35.36%	0.27%
自基金合同生效起至今	53.90%	1.54%	16.80%	1.29%	37.10%	0.25%

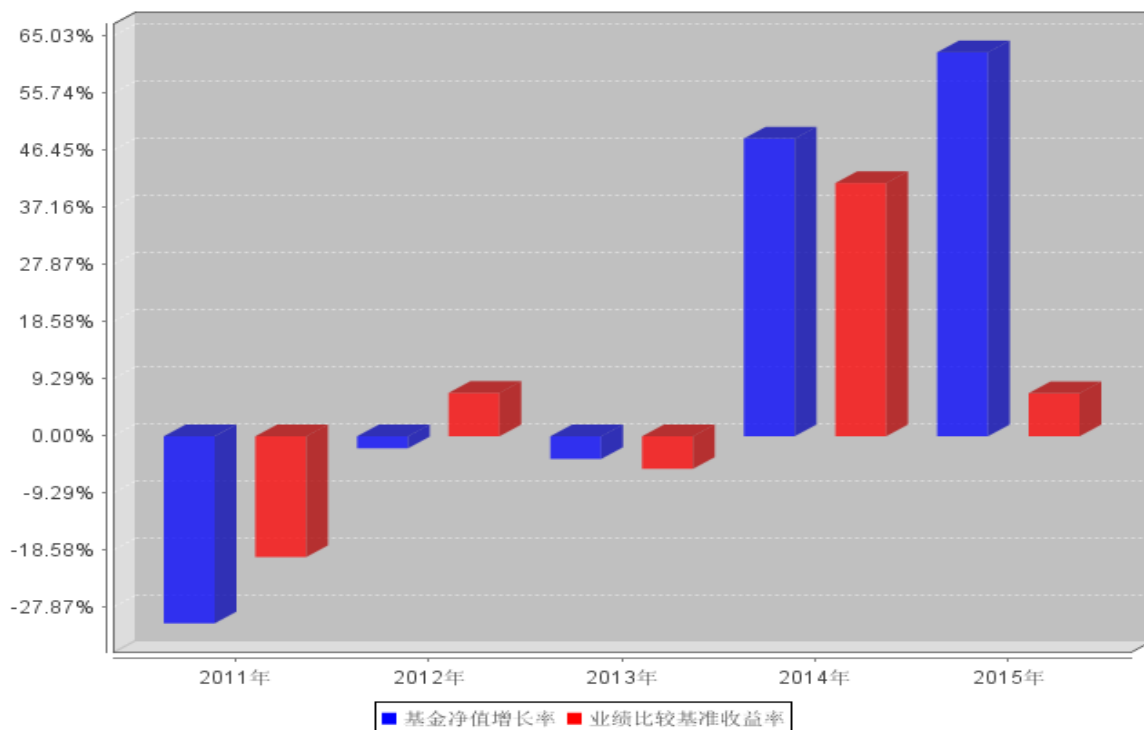
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：本基金的基金合同生效日为 2010 年 3 月 30 日，基金合同生效当年按实际存续期计算。

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		
杨德龙	本基金基金经理	2013年3月15日	-	9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、数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 16 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 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 月至今，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。

3. 2016 年 3 月 4 日，公司发布变更基金经理的公告，免去杨德龙本基金基金经理职务。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方策略优化混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有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

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。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1.509元；报告期内，基金份额净值增长率为62.43%，同期业绩基准增长率为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

整体来看，未来A股市场结构性牛市的动力仍在，上涨逻辑是利率不断下行和资产配置荒。一是整个经济中利率水平仍在下降，而我国居民可投资资产过百万亿元，大类资产配置会倾向于权益类资产投资；二是经济改革转型加速推进，改革红利的释放提升许多受益产业的估值水平。三是宽松货币政策逻辑未改变。展望未来一段时间，A股仍将有不错的投资机会。

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，积极组织了多项法律法规、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：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，本报告期本基金未有分配事项。

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

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 21248 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方策略优化混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的南方策略优化混合型证券投资基金(原南方策略优化股票型证券投资基金，以下简称“南方策略优化基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、 2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是南方策略优化基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。

	选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述南方策略优化基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了南方策略优化基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛 竞 陈 熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	50,937,223.20	38,610,128.53
结算备付金		1,268,641.46	4,709,671.57
存出保证金		174,806.74	98,813.41
交易性金融资产	7.4.7.2	400,981,001.22	628,184,912.38
其中：股票投资		400,981,001.22	627,532,699.28
基金投资		-	-
债券投资		-	652,213.10
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	-	13,000,000.00
应收证券清算款		1,656,947.62	10,103,216.81
应收利息	7.4.7.5	10,949.21	11,358.99
应收股利		-	-
应收申购款		4,176,860.89	465,006.91

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		459,206,430.34	695,183,108.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	4,024,735.75
应付赎回款		1,798,295.30	3,272,587.42
应付管理人报酬		537,210.43	895,566.73
应付托管费		89,535.08	149,261.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,458,858.14	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	7.4.7.8	357,314.57	276,981.96
负债合计		6,241,213.52	10,387,690.63
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	300,223,083.71	737,168,481.26
未分配利润	7.4.7.10	152,742,133.11	-52,373,063.29
所有者权益合计		452,965,216.82	684,795,417.97
负债和所有者权益总计		459,206,430.34	695,183,108.60

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5090 元，基金份额总额

300,223,083.71 份。

7.2 利润表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	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
一、收入		258,273,086.17	229,807,933.63
1. 利息收入		642,651.10	2,044,543.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	370,996.99	182,894.12
债券利息收入		1,022.52	740,861.14

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		270,631.59	1,120,787.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		318,518,080.43	104,381,943.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	315,176,274.43	100,934,283.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	418,087.15	140,368.56
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	2,923,718.85	3,307,291.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-61,572,692.52	123,167,595.67
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	685,047.16	213,851.69
减：二、费用		17,339,694.00	12,597,280.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,450,007.97	7,500,520.64
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,241,668.09	1,250,086.78
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	8,268,082.73	3,464,940.94
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	379,935.21	381,732.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		240,933,392.17	217,210,652.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		240,933,392.17	217,210,652.65

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期：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	737,168,481.26	-52,373,063.29	684,795,417.97

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	240,933,392.17	240,933,392.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-436,945,397.55	-35,818,195.77	-472,763,593.32
其中:1.基金申购款	393,301,563.58	164,739,469.58	558,041,033.16
2.基金赎回款	-830,246,961.13	-200,557,665.35	-1,030,804,626.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	300,223,083.71	152,742,133.11	452,965,216.82
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)	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(本期利润)	-	217,210,652.65	217,210,652.65
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)	-36,942,430.43	19,661,179.99	-17,281,250.44
其中:1.基金申购款	386,807,273.09	-73,741,853.10	313,065,419.99
2.基金赎回款	-423,749,703.52	93,403,033.09	-330,346,670.43
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)	737,168,481.26	-52,373,063.29	684,795,417.97

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

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方策略优化混合型证券投资基金(原名为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]第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(以下简称“招商银行”)。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,南方策略优化股票型证券投资基金于2015年8月7日公告后更名为南方策略优化混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方策略优化混合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类股票、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2016年3月25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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方消费活力灵活配置混合型发起式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、中国

基金业协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 2015 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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度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。

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和债券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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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，其公允价值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，但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。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，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) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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》、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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	50,937,223.20	38,610,128.53
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	50,937,223.20	38,610,128.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	344,627,377.66	400,981,001.22	56,353,623.56
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	344,627,377.66	400,981,001.22	56,353,623.56
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	509,756,596.30	627,532,699.28	117,776,102.98
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	502,000.00	652,213.10
	银行间市场	-	-
	合计	502,000.00	652,213.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	510,258,596.30	628,184,912.38	117,926,316.08

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	-	-
项目	上年度末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

买入返售证券	13,000,000.00	-
合计	13,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	10,234.65	8,558.87
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	627.99	2,331.34
应收债券利息	-	419.83
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	86.57	48.95
合计	10,949.21	11,358.99

7.4.7.6 其他资产

注：无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,458,858.14	1,768,557.65
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,458,858.14	1,768,557.65

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,314.57	8,481.96

预提费用	355,000.00	268,500.00
合计	357,314.57	276,981.96

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	737,168,481.26	737,168,481.26
本期申购	393,301,563.58	393,301,563.58
本期赎回（以“-”号填列）	-830,246,961.13	-830,246,961.13
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	300,223,083.71	300,223,083.71

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-131,458,890.12	79,085,826.83	-52,373,063.29
本期利润	302,506,084.69	-61,572,692.52	240,933,392.17
本期基金份额交易产生的变动数	-58,688,081.99	22,869,886.22	-35,818,195.77
其中：基金申购款	143,872,960.05	20,866,509.53	164,739,469.58
基金赎回款	-202,561,042.04	2,003,376.69	-200,557,665.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112,359,112.58	40,383,020.53	152,742,133.11

7.4.7.11 存款利息收入

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
	活期存款利息收入	319,127.91
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	45,327.60	65,559.54
其他	6,541.48	7,279.80

合计	370,996.99	182,894.12
----	------------	------------

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	2,902,773,676.24	1,155,376,234.85
减：卖出股票成本总额	2,587,597,401.81	1,054,441,951.53
买卖股票差价收入	315,176,274.43	100,934,283.32

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	945,529.50	20,933,956.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	526,000.00	19,883,580.00
减：应收利息总额	1,442.35	910,007.74
买卖债券差价收入	418,087.15	140,368.56

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	2,923,718.85	3,307,291.22

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,923,718.85	3,307,291.22

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-61,572,692.52	123,167,595.67
——股票投资	-61,422,479.42	123,005,574.97
——债券投资	-150,213.10	162,020.70
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-61,572,692.52	123,167,595.67

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	526,114.02	182,543.95
转换费	158,933.14	31,307.74
合计	685,047.16	213,851.69

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	8,268,082.73	3,464,940.94
银行间市场交易费用	-	-
合计	8,268,082.73	3,464,940.94

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	11,435.21	4,232.62
账户维护费	13,500.00	22,500.00
合计	379,935.21	381,732.62

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“南方基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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	566,990,218.34	10.65%	875,655,257.15	38.43%

7.4.10.1.2 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	501,737.29	10.47%	1,272,500.16	36.79%
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	774,881.24	38.02%	770,762.87	43.58%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	7,450,007.97
其中：支付销售机构的客户维护费	2,110,799.23	2,237,493.55

注：支付基金管理人南方基金管理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。

7.4.10.2.2 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12月

	12 月 31 日	31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,241,668.09	1,250,086.78

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	-	50,003,000.06
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	-	50,003,000.06
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	-	-

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		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
招商银行	50,937,223.20	319,127.91	38,610,128.53	110,054.78

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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

本期 2015年1月1日至2015年12月31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
无					
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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
兴业证券	002089	新海宜	配股	124,819	450,596.59

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末及上年度末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
000002	万科A	2015-12-18	重大资产重组	24.43	未知	未知	137,300	1,997,711.00	3,354,239.00	-
600452	涪陵电力	2015-12-30	重大资产重组	32.89	2016-03-10	29.60	68,537	1,716,971.58	2,254,181.93	-
000968	煤气化	2015-12-24	重大资产重组	8.71	未知	未知	254,038	1,862,287.35	2,212,670.98	-
300063	天龙集团	2015-12-22	重大资产重组	43.33	未知	未知	48,200	1,822,705.00	2,088,506.00	-
600379	宝光股份	2015-11-24	重大资产重组	21.76	未知	未知	91,925	1,426,951.25	2,000,288.00	-
000430	张家界	2015-12-15	重大资产重组	15.56	2016-01-14	14.00	127,500	1,470,789.94	1,983,900.00	-
002084	海鸥卫浴	2015-12-18	重大事项	13.27	2016-01-15	11.94	149,300	1,670,462.00	1,981,211.00	-
002542	中化岩土	2015-12-28	重大资产重组	13.59	未知	未知	142,500	1,966,680.00	1,936,575.00	-
300116	坚瑞消防	2015-12-29	重大资产重组	11.45	2016-03-22	12.60	169,100	1,581,878.91	1,936,195.00	-
002624	完美环球	2015-07-07	重大资产重组	21.03	2016-01-20	23.13	82,504	1,550,252.13	1,735,059.12	-

002201	九鼎新材	2015-11-17	重大资产重组	16.01	未知	未知	107,061	1,599,279.57	1,714,046.61	-
002530	丰东股份	2015-06-08	重大事项	14.99	2016-01-25	21.34	112,800	1,554,532.00	1,690,872.00	-
600847	万里股份	2015-08-18	重大资产重组	33.09	未知	未知	43,500	1,042,191.50	1,439,415.00	-
002652	扬子新材	2015-10-26	重大资产重组	12.12	未知	未知	114,400	1,273,252.00	1,386,528.00	-
002075	沙钢股份	2015-06-25	重大资产重组	13.91	2016-01-21	21.21	88,900	1,709,004.00	1,236,599.00	-
000833	贵糖股份	2015-10-19	重大事项	10.20	2016-01-19	9.18	118,900	1,198,671.00	1,212,780.00	-
000153	丰原药业	2015-10-14	重大资产重组	10.44	未知	未知	107,400	1,099,704.00	1,121,256.00	-
002239	奥特佳	2015-05-25	重大资产重组	18.32	2016-01-05	16.49	58,300	779,418.00	1,068,056.00	-
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	71.47	未知	未知	13,200	848,810.21	943,404.00	-
000813	天山纺织	2015-05-04	重大资产重组	11.25	2016-01-15	12.38	58,300	651,469.13	655,875.00	-
002235	安妮股份	2015-07-02	重大资产重组	24.59	2016-01-12	32.00	20,700	612,575.59	509,013.00	-
002286	保龄宝	2015-08-03	重大资产重组	14.50	2016-02-24	15.95	32,900	435,425.58	477,050.00	-
002452	长高集团	2015-07-20	重大资产重组	9.14	2016-01-06	10.05	47,400	500,187.83	433,236.00	-
002219	恒康医疗	2015-07-08	重大资产重组	14.90	未知	未知	27,000	428,033.15	402,300.00	-
000748	长城信息	2015-06-18	重大资产重组	34.88	2016-03-10	31.39	11,500	300,176.61	401,120.00	-
002465	海格通信	2015-12-30	重大事项	16.69	2016-02-04	15.02	23,600	373,797.85	393,884.00	-
600988	赤峰黄金	2015-08-31	重大事项	11.57	2016-01-05	12.73	32,696	472,130.83	378,292.72	-
002409	雅克科技	2015-07-08	重大事项	21.96	2016-02-29	24.16	15,300	459,447.99	335,988.00	-
000929	兰州黄河	2015-10-09	重大资产重组	12.50	未知	未知	26,233	447,448.03	327,912.50	-
000876	新希望	2015-08-17	重大事项	18.99	2016-03-02	17.09	15,300	329,970.48	290,547.00	-
002502	攀威股份	2015-08-20	重大资产重组	25.50	2016-01-14	23.35	11,200	236,320.00	285,600.00	-
600990	四创电子	2015-08-31	重大资产重组	82.63	未知	未知	3,300	236,900.13	272,679.00	-
600864	哈投股份	2015-10-09	重大资产重组	10.88	2016-01-14	11.97	22,400	405,614.56	243,712.00	-
000023	深天地 A	2015-08-18	重大资产重组	30.53	未知	未知	7,900	147,415.00	241,187.00	-
300028	金亚科技	2015-06-09	重大事项	11.42	未知	未知	20,800	789,364.00	237,536.00	-
600490	鹏欣资源	2015-08-28	重大资产重组	6.61	2016-03-02	7.27	31,700	340,479.44	209,537.00	-
002103	广博股份	2015-09-07	重大资产重组	17.52	2016-02-16	19.27	9,200	191,846.00	161,184.00	-
002514	宝馨科技	2015-07-08	重大事项	14.80	2016-01-08	16.28	9,600	201,048.39	142,080.00	-
300036	超图软件	2015-10-30	重大资产重组	39.01	2016-01-15	35.11	2,660	78,454.22	103,766.60	-
300323	华灿光电	2015-12-29	重大事项	10.18	2016-01-04	10.20	9,600	68,976.00	97,728.00	-
600578	京能电力	2015-11-05	重大资产重组	6.07	2016-02-24	5.49	15,900	92,924.00	96,513.00	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大资产重组	56.68	未知	未知	1,700	55,385.80	96,356.00	-
000035	中国天楹	2015-12-14	重大资产重组	15.35	2016-02-18	13.82	6,100	96,250.37	93,635.00	-
000980	金马股份	2015-09-29	重大资产重组	6.20	未知	未知	14,600	106,031.99	90,520.00	-
002320	海峡股份	2015-06-25	重大资产重组	27.43	2016-01-07	24.69	3,200	82,705.00	87,776.00	-
600771	广誉远	2015-11-17	重大资产重组	31.98	2016-03-09	28.78	2,700	73,467.00	86,346.00	-
002383	合众思壮	2015-12-15	重大事项	40.35	2016-03-17	36.32	2,100	73,059.60	84,735.00	-
300049	福瑞股份	2015-11-30	重大资产重组	31.00	2016-01-04	30.95	2,700	75,735.00	83,700.00	-
300194	福安药业	2015-10-08	重大资产重组	18.95	2016-01-04	20.85	4,300	93,733.22	81,485.00	-
000836	鑫茂科技	2015-11-24	重大资产重组	23.09	未知	未知	3,400	61,574.00	78,506.00	-
002313	日海通讯	2015-08-10	重大事项	14.80	2016-01-22	13.90	5,300	69,203.00	78,440.00	-
300025	华星创业	2015-11-26	重大资产重组	30.15	未知	未知	1,600	25,501.25	48,240.00	-

300313	天山生物	2015-11-03	重大资产重组	17.70	未知	未知	2,200	30,976.48	38,940.00	-
300365	恒华科技	2015-11-16	重大资产重组	42.87	2016-01-27	38.58	600	15,266.08	25,722.00	-

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险策略部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风控策略部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能

性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债（2014 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.10%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	50,937,223.20	-	-	-	50,937,223.20
结算备付金	1,268,641.46	-	-	-	1,268,641.46
存出保证金	174,806.74	-	-	-	174,806.74
交易性金融资产	-	-	-	400,981,001.22	400,981,001.22
应收证券清算款	-	-	-	1,656,947.62	1,656,947.62
应收利息	-	-	-	10,949.21	10,949.21
应收申购款	194,428.62	-	-	3,982,432.27	4,176,860.89
资产总计	52,575,100.02	-	-	406,631,330.32	459,206,430.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,798,295.30	1,798,295.30
应付管理人报酬	-	-	-	537,210.43	537,210.43
应付托管费	-	-	-	89,535.08	89,535.08
应付交易费用	-	-	-	3,458,858.14	3,458,858.14
其他负债	-	-	-	357,314.57	357,314.57
负债总计	-	-	-	6,241,213.52	6,241,213.52
利率敏感度缺口	52,575,100.02	-	-	400,390,116.80	452,965,216.82
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2014年12月31日					
资产					
银行存款	38,610,128.53	-	-	-	38,610,128.53
结算备付金	4,709,671.57	-	-	-	4,709,671.57
存出保证金	98,813.41	-	-	-	98,813.41
交易性金融资产		348,922.10	303,291.00	627,532,699.28	628,184,912.38
买入返售金融资产	13,000,000.00	-	-	-	13,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	10,103,216.81	10,103,216.81
应收利息	-	-	-	11,358.99	11,358.99
应收申购款	9,940.36	-	-	455,066.55	465,006.91
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	56,428,553.87	348,922.10	303,291.00	638,102,341.63	695,183,108.60
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,024,735.75	4,024,735.75
应付赎回款	-	-	-	3,272,587.42	3,272,587.42
应付管理人报酬	-	-	-	895,566.73	895,566.73
应付托管费	-	-	-	149,261.12	149,261.12
应付交易费用	-	-	-	1,768,557.65	1,768,557.65
其他负债	-	-	-	276,981.96	276,981.96
负债总计	-	-	-	10,387,690.63	10,387,690.63
利率敏感度缺口	56,428,553.87	348,922.10	303,291.00	627,714,651.00	684,795,417.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金未持有的交易性债券投资 2015 年 12 月 31 日：未持有的交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.1%）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中，股票占基金资产的 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占基金资产的 5-40%；权证占基金资产的 0-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	400,981,001.22	88.52	627,532,699.28	91.64
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	400,981,001.22	88.52	627,532,699.28	91.64

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末(2015 年 12 月 31 日)	上年度末(2014 年 12 月 31 日)

1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	2,280.00	2,799.00
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	2,280.00	2,799.00

7.4.14 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 360,014,076.76 元，属于第二层次的余额为 40,729,388.46 元，属于第三层次的余额为 237,536.00 元(2014 年 12 月 31 日：第一层次 593,865,505.74 元，第二层次 34,319,406.64 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不含权固定收益品种(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

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	400,981,001.22	87.32
	其中：股票	400,981,001.22	87.32
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	52,205,864.66	11.37
7	其他各项资产	6,019,564.46	1.31
8	合计	459,206,430.34	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	7,557,158.60	1.67

B	采矿业	7,784,936.70	1.72
C	制造业	261,303,182.73	57.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,505,985.99	3.42
E	建筑业	14,701,506.80	3.25
F	批发和零售业	28,502,102.94	6.29
G	交通运输、仓储和邮政业	3,968,754.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,595,501.46	1.24
J	金融业	23,883,860.47	5.27
K	房地产业	19,103,454.04	4.22
L	租赁和商务服务业	38,400.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	46,900.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	8,938,184.72	1.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	189,480.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	3,861,592.77	0.85
S	综合	-	-
	合计	400,981,001.22	88.52

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000838	财信发展	86,500	3,479,895.00	0.77
2	000002	万科 A	137,300	3,354,239.00	0.74
3	601166	兴业银行	165,500	2,825,085.00	0.62
4	000018	神州长城	56,559	2,782,702.80	0.61
5	002295	精艺股份	113,700	2,682,183.00	0.59
6	600774	汉商集团	94,400	2,511,040.00	0.55
7	000605	渤海股份	75,900	2,503,941.00	0.55
8	600766	园城黄金	119,500	2,435,410.00	0.54
9	002656	卡奴迪路	84,809	2,426,385.49	0.54

10	000055	方大集团	168,000	2,415,840.00	0.53
11	300121	阳谷华泰	149,800	2,411,780.00	0.53
12	000498	山东路桥	265,700	2,383,329.00	0.53
13	600470	六国化工	209,300	2,379,741.00	0.53
14	600182	S 佳通	106,700	2,371,941.00	0.52
15	002220	天宝股份	145,600	2,351,440.00	0.52
16	600573	惠泉啤酒	128,000	2,336,000.00	0.52
17	002524	光正集团	219,550	2,327,230.00	0.51
18	300239	东宝生物	125,301	2,325,586.56	0.51
19	600475	华光股份	112,070	2,318,728.30	0.51
20	000056	皇庭国际	68,000	2,300,440.00	0.51
21	300117	嘉寓股份	177,315	2,290,909.80	0.51
22	600619	海立股份	133,600	2,285,896.00	0.50
23	000756	新华制药	169,200	2,268,972.00	0.50
24	000978	桂林旅游	159,900	2,265,783.00	0.50
25	300278	华昌达	99,200	2,258,784.00	0.50
26	600647	同达创业	70,253	2,258,633.95	0.50
27	002328	新朋股份	164,550	2,257,626.00	0.50
28	002449	国星光电	133,500	2,256,150.00	0.50
29	600452	涪陵电力	68,537	2,254,181.93	0.50
30	600493	凤竹纺织	133,884	2,251,928.88	0.50
31	600706	曲江文旅	93,800	2,250,262.00	0.50
32	002160	常铝股份	171,100	2,243,121.00	0.50
33	600030	中信证券	115,160	2,228,346.00	0.49
34	002600	江粉磁材	191,500	2,225,230.00	0.49
35	002495	佳隆股份	258,300	2,218,797.00	0.49
36	000968	煤气化	254,038	2,212,670.98	0.49
37	300320	海达股份	145,700	2,211,726.00	0.49
38	600605	汇通能源	86,320	2,211,518.40	0.49
39	000530	大冷股份	116,274	2,206,880.52	0.49
40	300258	精锻科技	122,500	2,186,625.00	0.48
41	600769	祥龙电业	152,400	2,168,652.00	0.48
42	000407	胜利股份	260,100	2,161,431.00	0.48
43	000798	中水渔业	158,500	2,155,600.00	0.48
44	300214	日科化学	196,800	2,147,088.00	0.47
45	600833	第一医药	106,200	2,140,992.00	0.47
46	600889	南京化纤	134,800	2,139,276.00	0.47
47	600566	济川药业	77,200	2,135,352.00	0.47
48	002579	中京电子	135,750	2,129,917.50	0.47

49	002165	红宝丽	241,100	2,128,913.00	0.47
50	002420	毅昌股份	183,100	2,127,622.00	0.47
51	002115	三维通信	133,900	2,124,993.00	0.47
52	600333	长春燃气	242,000	2,122,340.00	0.47
53	600828	成商集团	221,699	2,115,008.46	0.47
54	002451	摩恩电气	144,984	2,109,517.20	0.47
55	600579	天华院	126,400	2,107,088.00	0.47
56	600211	西藏药业	48,101	2,105,861.78	0.46
57	300218	安利股份	120,200	2,103,500.00	0.46
58	000552	靖远煤电	208,600	2,102,688.00	0.46
59	300063	天龙集团	48,200	2,088,506.00	0.46
60	000004	国农科技	45,500	2,088,450.00	0.46
61	300301	长方集团	193,700	2,080,338.00	0.46
62	002526	山东矿机	179,000	2,079,980.00	0.46
63	002054	德美化工	147,368	2,077,888.80	0.46
64	002377	国创高新	200,900	2,075,297.00	0.46
65	002523	天桥起重	219,300	2,072,385.00	0.46
66	002125	湘潭电化	88,600	2,068,810.00	0.46
67	600529	山东药玻	106,900	2,066,377.00	0.46
68	000608	阳光股份	333,200	2,065,840.00	0.46
69	002087	新野纺织	242,700	2,065,377.00	0.46
70	002327	富安娜	171,500	2,063,145.00	0.46
71	600558	大西洋	226,000	2,061,120.00	0.46
72	002613	北玻股份	263,150	2,060,464.50	0.45
73	002490	山东墨龙	180,100	2,060,344.00	0.45
74	600883	博闻科技	114,257	2,060,053.71	0.45
75	300265	通光线缆	132,244	2,056,394.20	0.45
76	600178	东安动力	183,100	2,056,213.00	0.45
77	300341	麦迪电气	75,000	2,055,750.00	0.45
78	600356	恒丰纸业	160,800	2,046,984.00	0.45
79	600054	黄山旅游	86,552	2,043,492.72	0.45
80	000429	粤高速 A	295,600	2,042,596.00	0.45
81	002403	爱仕达	128,080	2,040,314.40	0.45
82	300138	晨光生物	95,696	2,039,281.76	0.45
83	000010	深华新	201,800	2,038,180.00	0.45
84	002635	安洁科技	73,256	2,036,516.80	0.45
85	002533	金杯电工	206,500	2,034,025.00	0.45
86	300196	长海股份	57,100	2,032,189.00	0.45
87	300095	华伍股份	133,650	2,027,470.50	0.45

88	600543	莫高股份	156,300	2,022,522.00	0.45
89	600051	宁波联合	152,700	2,021,748.00	0.45
90	300127	银河磁体	111,096	2,019,725.28	0.45
91	002333	罗普斯金	93,318	2,019,401.52	0.45
92	300022	吉峰农机	183,900	2,017,383.00	0.45
93	601798	蓝科高新	142,500	2,013,525.00	0.44
94	000576	广东甘化	102,500	2,009,000.00	0.44
95	600379	宝光股份	91,925	2,000,288.00	0.44
96	601579	会稽山	144,400	1,997,052.00	0.44
97	000698	沈阳化工	251,600	1,995,188.00	0.44
98	600791	京能置业	212,700	1,995,126.00	0.44
99	000757	浩物股份	156,259	1,993,864.84	0.44
100	002198	嘉应制药	181,800	1,988,892.00	0.44
101	000430	张家界	127,500	1,983,900.00	0.44
102	002084	海鸥卫浴	149,300	1,981,211.00	0.44
103	000421	南京中北	205,100	1,977,164.00	0.44
104	600843	上工申贝	117,600	1,972,152.00	0.44
105	002255	海陆重工	189,096	1,968,489.36	0.43
106	600731	湖南海利	166,900	1,964,413.00	0.43
107	000570	苏常柴A	179,373	1,958,753.16	0.43
108	600837	海通证券	123,489	1,953,595.98	0.43
109	002532	新界泵业	128,002	1,953,310.52	0.43
110	600981	汇鸿集团	150,065	1,946,343.05	0.43
111	603123	翠微股份	176,800	1,939,496.00	0.43
112	603333	明星电缆	201,545	1,938,862.90	0.43
113	300129	泰胜风能	208,709	1,936,819.52	0.43
114	000419	通程控股	215,200	1,936,800.00	0.43
115	002542	中化岩土	142,500	1,936,575.00	0.43
116	300116	坚瑞消防	169,100	1,936,195.00	0.43
117	002478	常宝股份	135,800	1,935,150.00	0.43
118	000715	中兴商业	137,602	1,931,932.08	0.43
119	600218	全柴动力	142,200	1,929,654.00	0.43
120	300173	智慧松德	107,500	1,927,475.00	0.43
121	600393	东华实业	152,900	1,915,837.00	0.42
122	000637	茂化实华	230,790	1,910,941.20	0.42
123	002302	西部建设	106,900	1,904,958.00	0.42
124	002397	梦洁家纺	185,200	1,903,856.00	0.42
125	002100	天康生物	189,069	1,902,034.14	0.42
126	002616	长青集团	71,400	1,901,382.00	0.42

127	600975	新五丰	112,900	1,897,849.00	0.42
128	300237	美晨科技	152,500	1,897,100.00	0.42
129	002225	濮耐股份	247,900	1,896,435.00	0.42
130	601328	交通银行	294,400	1,895,936.00	0.42
131	002264	新华都	221,400	1,888,542.00	0.42
132	600853	龙建股份	247,200	1,881,192.00	0.42
133	002507	涪陵榨菜	99,251	1,862,941.27	0.41
134	002516	旷达科技	129,300	1,861,920.00	0.41
135	000615	湖北金环	118,000	1,858,500.00	0.41
136	603002	宏昌电子	241,200	1,854,828.00	0.41
137	600512	腾达建设	335,900	1,844,091.00	0.41
138	000663	永安林业	109,600	1,843,472.00	0.41
139	600751	天海投资	191,100	1,838,382.00	0.41
140	601908	京运通	221,100	1,817,442.00	0.40
141	000404	华意压缩	193,672	1,810,833.20	0.40
142	600891	秋林集团	175,100	1,807,032.00	0.40
143	300119	瑞普生物	89,700	1,802,970.00	0.40
144	000908	景峰医药	111,800	1,802,216.00	0.40
145	600617	国新能源	117,171	1,796,231.43	0.40
146	600505	西昌电力	163,600	1,794,692.00	0.40
147	002374	丽鹏股份	105,000	1,774,500.00	0.39
148	600232	金鹰股份	158,400	1,770,912.00	0.39
149	600152	维科精华	145,300	1,763,942.00	0.39
150	600744	华银电力	206,300	1,761,802.00	0.39
151	002624	完美环球	82,504	1,735,059.12	0.38
152	300067	安诺其	166,297	1,724,499.89	0.38
153	002201	九鼎新材	107,061	1,714,046.61	0.38
154	002530	丰东股份	112,800	1,690,872.00	0.37
155	600359	新农开发	135,560	1,621,297.60	0.36
156	300108	双龙股份	93,900	1,521,180.00	0.34
157	600847	万里股份	43,500	1,439,415.00	0.32
158	601989	中国重工	151,800	1,426,920.00	0.32
159	002652	扬子新材	114,400	1,386,528.00	0.31
160	601988	中国银行	341,000	1,367,410.00	0.30
161	601601	中国太保	46,566	1,343,894.76	0.30
162	601288	农业银行	387,200	1,250,656.00	0.28
163	601818	光大银行	294,700	1,249,528.00	0.28
164	002075	沙钢股份	88,900	1,236,599.00	0.27
165	002150	通润装备	95,700	1,213,476.00	0.27

166	000833	贵糖股份	118,900	1,212,780.00	0.27
167	000153	丰原药业	107,400	1,121,256.00	0.25
168	002239	奥特佳	58,300	1,068,056.00	0.24
169	000001	平安银行	85,181	1,021,320.19	0.23
170	600048	保利地产	93,100	990,584.00	0.22
171	000333	美的集团	29,400	964,908.00	0.21
172	600015	华夏银行	78,359	951,278.26	0.21
173	600271	航天信息	13,200	943,404.00	0.21
174	600276	恒瑞医药	16,900	830,128.00	0.18
175	601939	建设银行	140,900	814,402.00	0.18
176	600999	招商证券	36,378	789,402.60	0.17
177	000776	广发证券	38,881	756,235.45	0.17
178	600518	康美药业	44,300	750,885.00	0.17
179	600637	东方明珠	19,200	727,488.00	0.16
180	601628	中国人寿	25,113	710,949.03	0.16
181	000813	天山纺织	58,300	655,875.00	0.14
182	300027	华谊兄弟	15,600	647,088.00	0.14
183	000063	中兴通讯	34,500	642,735.00	0.14
184	601336	新华保险	11,200	584,752.00	0.13
185	001979	招商蛇口	28,014	584,372.04	0.13
186	601901	方正证券	60,600	581,760.00	0.13
187	300179	四方达	52,450	572,229.50	0.13
188	000538	云南白药	7,650	555,543.00	0.12
189	600011	华能国际	62,300	543,879.00	0.12
190	002202	金风科技	23,400	533,286.00	0.12
191	601009	南京银行	29,606	524,026.20	0.12
192	600100	同方股份	28,900	522,512.00	0.12
193	002235	安妮股份	20,700	509,013.00	0.11
194	000768	中航飞机	20,400	505,308.00	0.11
195	002286	保龄宝	32,900	477,050.00	0.11
196	600085	同仁堂	10,600	472,866.00	0.10
197	000725	京东方A	155,800	462,726.00	0.10
198	300017	网宿科技	7,600	455,924.00	0.10
199	600109	国金证券	27,600	444,912.00	0.10
200	002452	长高集团	47,400	433,236.00	0.10
201	002142	宁波银行	27,500	426,525.00	0.09
202	600369	西南证券	41,900	414,810.00	0.09
203	000728	国元证券	17,900	404,361.00	0.09
204	000402	金融街	34,900	402,397.00	0.09

205	002219	恒康医疗	27,000	402,300.00	0.09
206	600196	复星医药	17,100	401,679.00	0.09
207	601788	光大证券	17,500	401,450.00	0.09
208	000748	长城信息	11,500	401,120.00	0.09
209	600535	天士力	9,800	401,016.00	0.09
210	002465	海格通信	23,600	393,884.00	0.09
211	000423	东阿阿胶	7,500	392,250.00	0.09
212	600804	鹏博士	16,100	381,892.00	0.08
213	600988	赤峰黄金	32,696	378,292.72	0.08
214	600177	雅戈尔	23,000	374,440.00	0.08
215	002152	广电运通	12,000	371,880.00	0.08
216	600674	川投能源	33,200	357,232.00	0.08
217	601555	东吴证券	21,400	343,898.00	0.08
218	002409	雅克科技	15,300	335,988.00	0.07
219	000623	吉林敖东	10,600	328,070.00	0.07
220	000929	兰州黄河	26,233	327,912.50	0.07
221	002252	上海莱士	8,200	326,114.00	0.07
222	600867	通化东宝	12,000	326,040.00	0.07
223	601998	中信银行	45,100	325,622.00	0.07
224	000793	华闻传媒	21,200	318,636.00	0.07
225	300003	乐普医疗	7,900	304,940.00	0.07
226	600079	人福医药	13,535	301,289.10	0.07
227	000826	启迪桑德	7,600	301,112.00	0.07
228	600023	浙能电力	40,100	300,349.00	0.07
229	000876	新希望	15,300	290,547.00	0.06
230	002502	骅威股份	11,200	285,600.00	0.06
231	601607	上海医药	14,300	284,713.00	0.06
232	000750	国海证券	21,300	273,705.00	0.06
233	600990	四创电子	3,300	272,679.00	0.06
234	002268	卫士通	4,700	264,187.00	0.06
235	601098	中南传媒	11,000	262,900.00	0.06
236	000046	泛海控股	20,800	261,040.00	0.06
237	600642	申能股份	34,200	258,210.00	0.06
238	600741	华域汽车	15,095	254,501.70	0.06
239	000963	华东医药	3,100	254,076.00	0.06
240	600007	中国国贸	13,400	251,652.00	0.06
241	600027	华电国际	36,300	246,840.00	0.05
242	002287	奇正藏药	5,900	245,322.00	0.05
243	600864	哈投股份	22,400	243,712.00	0.05

244	300002	神州泰岳	18,500	242,350.00	0.05
245	600332	白云山	8,000	242,160.00	0.05
246	000023	深天地A	7,900	241,187.00	0.05
247	300028	金亚科技	20,800	237,536.00	0.05
248	002603	以岭药业	12,800	232,064.00	0.05
249	000413	东旭光电	25,400	230,632.00	0.05
250	300148	天舟文化	13,100	230,560.00	0.05
251	000078	海王生物	9,600	230,016.00	0.05
252	600060	海信电器	11,600	228,172.00	0.05
253	600879	航天电子	12,700	226,949.00	0.05
254	002475	立讯精密	7,102	226,908.90	0.05
255	600498	烽火通信	7,700	219,527.00	0.05
256	600664	哈药股份	18,400	219,512.00	0.05
257	000792	盐湖股份	8,500	218,280.00	0.05
258	000801	四川九洲	6,900	213,417.00	0.05
259	600490	鹏欣资源	31,700	209,537.00	0.05
260	600522	中天科技	9,100	208,390.00	0.05
261	300026	红日药业	9,800	206,780.00	0.05
262	300212	易华录	4,400	203,148.00	0.04
263	000883	湖北能源	33,000	202,620.00	0.04
264	600038	中直股份	3,700	195,101.00	0.04
265	002007	华兰生物	4,400	193,600.00	0.04
266	000661	长春高新	1,600	192,720.00	0.04
267	600845	宝信软件	3,328	192,424.96	0.04
268	300182	捷成股份	8,000	192,000.00	0.04
269	600021	上海电力	12,900	189,888.00	0.04
270	300015	爱尔眼科	6,000	189,480.00	0.04
271	300078	思创医惠	3,800	185,440.00	0.04
272	601928	凤凰传媒	11,501	183,210.93	0.04
273	300287	飞利信	10,100	182,810.00	0.04
274	000671	阳光城	20,100	181,503.00	0.04
275	002032	苏泊尔	6,400	178,048.00	0.04
276	601929	吉视传媒	28,700	177,366.00	0.04
277	300204	舒泰神	5,000	177,200.00	0.04
278	600208	新潮中宝	37,100	176,967.00	0.04
279	002262	恩华药业	6,000	175,620.00	0.04
280	600521	华海药业	6,900	175,191.00	0.04
281	002179	中航光电	4,600	174,616.00	0.04
282	300136	信维通信	5,900	174,345.00	0.04

283	002063	远光软件	8,135	171,973.90	0.04
284	300267	尔康制药	5,100	171,360.00	0.04
285	300207	欣旺达	6,000	168,600.00	0.04
286	300077	国民技术	3,700	167,166.00	0.04
287	300166	东方国信	5,200	166,556.00	0.04
288	300146	汤臣倍健	4,300	165,550.00	0.04
289	300199	翰宇药业	6,700	165,021.00	0.04
290	002626	金达威	8,500	164,985.00	0.04
291	600775	南京熊猫	8,600	164,690.00	0.04
292	002531	天顺风能	11,800	162,250.00	0.04
293	002519	银河电子	6,800	161,500.00	0.04
294	002103	广博股份	9,200	161,184.00	0.04
295	300367	东方网力	2,300	160,310.00	0.04
296	002583	海能达	12,600	157,374.00	0.03
297	600422	昆药集团	3,900	155,298.00	0.03
298	000681	视觉中国	4,000	152,040.00	0.03
299	600008	首创股份	14,600	148,774.00	0.03
300	002433	太安堂	10,000	148,600.00	0.03
301	600884	杉杉股份	3,700	145,188.00	0.03
302	000989	九芝堂	4,500	144,990.00	0.03
303	300224	正海磁材	6,200	143,592.00	0.03
304	600325	华发股份	8,800	143,440.00	0.03
305	002376	新北洋	7,700	142,296.00	0.03
306	002514	宝馨科技	9,600	142,080.00	0.03
307	002462	嘉事堂	2,800	141,736.00	0.03
308	300098	高新兴	6,740	141,472.60	0.03
309	002195	二三四五	3,800	140,600.00	0.03
310	000733	振华科技	5,600	140,000.00	0.03
311	002129	中环股份	11,400	139,308.00	0.03
312	002642	荣之联	2,400	138,936.00	0.03
313	002518	科士达	3,900	137,670.00	0.03
314	600829	人民同泰	8,200	136,202.00	0.03
315	000042	中洲控股	6,500	135,915.00	0.03
316	300110	华仁药业	9,700	135,897.00	0.03
317	600055	华润万东	3,200	135,424.00	0.03
318	002016	世荣兆业	10,000	135,300.00	0.03
319	300114	中航电测	2,700	135,297.00	0.03
320	002042	华孚色纺	11,200	134,960.00	0.03
321	300339	润和软件	2,800	134,456.00	0.03

322	300271	华宇软件	2,800	132,944.00	0.03
323	002294	信立泰	4,400	132,528.00	0.03
324	600129	太极集团	6,200	132,246.00	0.03
325	002512	达华智能	5,800	131,080.00	0.03
326	300209	天泽信息	5,076	130,960.80	0.03
327	000732	泰禾集团	5,300	129,850.00	0.03
328	002649	博彦科技	2,300	129,444.00	0.03
329	600290	华仪电气	8,200	126,362.00	0.03
330	600557	康缘药业	5,000	125,100.00	0.03
331	300296	利亚德	4,996	124,900.00	0.03
332	300109	新开源	1,200	124,860.00	0.03
333	002335	科华恒盛	2,600	124,800.00	0.03
334	600105	永鼎股份	5,400	124,254.00	0.03
335	002399	海普瑞	3,500	123,795.00	0.03
336	600056	中国医药	7,400	123,062.00	0.03
337	300090	盛运环保	10,500	122,955.00	0.03
338	601199	江南水务	6,400	121,920.00	0.03
339	002618	丹邦科技	2,500	121,650.00	0.03
340	002437	誉衡药业	4,000	121,000.00	0.03
341	002019	亿帆鑫富	3,000	120,000.00	0.03
342	000561	烽火电子	8,400	119,112.00	0.03
343	002546	新联电子	3,600	117,612.00	0.03
344	600380	健康元	8,500	117,470.00	0.03
345	600351	亚宝药业	7,500	117,150.00	0.03
346	002414	高德红外	3,800	115,786.00	0.03
347	300128	锦富新材	4,300	108,962.00	0.02
348	300302	同有科技	1,500	108,675.00	0.02
349	002349	精华制药	2,800	108,360.00	0.02
350	600614	鼎立股份	9,300	108,159.00	0.02
351	300332	天壕环境	4,400	107,360.00	0.02
352	002111	威海广泰	3,500	106,225.00	0.02
353	002151	北斗星通	2,000	104,360.00	0.02
354	300036	超图软件	2,660	103,766.60	0.02
355	002099	海翔药业	4,300	102,555.00	0.02
356	300047	天源迪科	3,500	101,850.00	0.02
357	002090	金智科技	2,600	100,412.00	0.02
358	600998	九州通	5,100	99,960.00	0.02
359	300327	中颖电子	2,500	99,250.00	0.02
360	300379	东方通	800	98,152.00	0.02

361	300233	金城医药	3,000	97,980.00	0.02
362	300323	华灿光电	9,600	97,728.00	0.02
363	600993	马应龙	4,400	96,888.00	0.02
364	300248	新开普	2,600	96,590.00	0.02
365	600578	京能电力	15,900	96,513.00	0.02
366	300038	梅泰诺	1,700	96,356.00	0.02
367	002025	航天电器	3,700	96,163.00	0.02
368	002253	川大智胜	1,800	95,940.00	0.02
369	002692	远程电缆	4,800	95,520.00	0.02
370	600697	欧亚集团	2,300	95,312.00	0.02
371	000035	中国天楹	6,100	93,635.00	0.02
372	300118	东方日升	6,400	93,248.00	0.02
373	002396	星网锐捷	3,800	91,770.00	0.02
374	600285	羚锐制药	6,900	91,425.00	0.02
375	000980	金马股份	14,600	90,520.00	0.02
376	600823	世茂股份	7,400	90,502.00	0.02
377	002436	兴森科技	4,700	90,475.00	0.02
378	002056	横店东磁	3,200	89,952.00	0.02
379	300356	光一科技	1,600	89,760.00	0.02
380	300289	利德曼	4,500	89,550.00	0.02
381	002331	皖通科技	3,300	89,364.00	0.02
382	601801	皖新传媒	2,729	89,183.72	0.02
383	600479	千金药业	4,200	88,074.00	0.02
384	002279	久其软件	1,300	88,010.00	0.02
385	300006	莱美药业	2,200	88,000.00	0.02
386	002177	御银股份	8,100	87,885.00	0.02
387	002320	海峡股份	3,200	87,776.00	0.02
388	002180	艾派克	1,900	87,685.00	0.02
389	002296	辉煌科技	4,100	87,658.00	0.02
390	300282	汇冠股份	2,624	86,408.32	0.02
391	600771	广誉远	2,700	86,346.00	0.02
392	002693	双成药业	5,800	86,130.00	0.02
393	300255	常山药业	4,900	85,799.00	0.02
394	300167	迪威视讯	4,000	85,680.00	0.02
395	000501	鄂武商 A	4,000	85,600.00	0.02
396	002039	黔源电力	4,300	85,097.00	0.02
397	000411	英特集团	3,200	85,088.00	0.02
398	002317	众生药业	6,400	84,736.00	0.02
399	002383	合众思壮	2,100	84,735.00	0.02

400	600116	三峡水利	3,903	84,695.10	0.02
401	300049	福瑞股份	2,700	83,700.00	0.02
402	000903	云内动力	10,000	83,000.00	0.02
403	300130	新国都	2,200	81,994.00	0.02
404	000045	深纺织 A	5,800	81,838.00	0.02
405	000418	小天鹅 A	3,400	81,600.00	0.02
406	300194	福安药业	4,300	81,485.00	0.02
407	600509	天富能源	8,300	81,423.00	0.02
408	000948	南天信息	3,200	80,992.00	0.02
409	600483	福能股份	4,700	80,793.00	0.02
410	300202	聚龙股份	2,500	80,475.00	0.02
411	000919	金陵药业	4,600	79,120.00	0.02
412	000836	鑫茂科技	3,400	78,506.00	0.02
413	002313	日海通讯	5,300	78,440.00	0.02
414	300232	洲明科技	2,000	78,260.00	0.02
415	002281	光迅科技	1,200	77,796.00	0.02
416	000156	华数传媒	2,300	75,440.00	0.02
417	002380	科远股份	1,876	75,208.84	0.02
418	000544	中原环保	3,900	75,075.00	0.02
419	600329	中新药业	3,526	74,680.68	0.02
420	002688	金河生物	3,200	74,592.00	0.02
421	600976	健民集团	2,200	74,426.00	0.02
422	600969	郴电国际	3,921	74,224.53	0.02
423	000705	浙江震元	3,900	73,164.00	0.02
424	600850	华东电脑	1,400	72,310.00	0.02
425	002653	海思科	3,300	72,237.00	0.02
426	600551	时代出版	3,100	70,525.00	0.02
427	300246	宝莱特	1,700	70,210.00	0.02
428	600101	明星电力	4,900	70,119.00	0.02
429	002133	广宇集团	7,200	69,480.00	0.02
430	300290	荣科科技	2,700	68,094.00	0.02
431	300042	朗科科技	1,600	66,880.00	0.01
432	600776	东方通信	5,800	66,352.00	0.01
433	002560	通达股份	1,500	65,250.00	0.01
434	300050	世纪鼎利	1,814	65,122.60	0.01
435	600657	信达地产	9,300	64,635.00	0.01
436	600080	金花股份	4,500	64,485.00	0.01
437	002727	一心堂	1,100	63,613.00	0.01
438	600488	天药股份	8,500	62,645.00	0.01

439	300270	中威电子	2,580	61,507.20	0.01
440	300357	我武生物	1,200	60,840.00	0.01
441	603005	晶方科技	1,200	60,360.00	0.01
442	300312	邦讯技术	1,400	60,060.00	0.01
443	300139	晓程科技	3,300	59,301.00	0.01
444	300363	博腾股份	2,176	59,034.88	0.01
445	600613	神奇制药	2,700	58,212.00	0.01
446	603001	奥康国际	1,700	57,154.00	0.01
447	300250	初灵信息	700	55,713.00	0.01
448	300206	理邦仪器	2,000	55,120.00	0.01
449	300292	吴通控股	1,300	54,990.00	0.01
450	600203	福日电子	4,000	54,840.00	0.01
451	002566	益盛药业	3,300	53,790.00	0.01
452	300241	瑞丰光电	2,901	52,218.00	0.01
453	601999	出版传媒	4,100	52,070.00	0.01
454	000862	银星能源	5,000	49,250.00	0.01
455	300169	天晟新材	2,810	48,613.00	0.01
456	300025	华星创业	1,600	48,240.00	0.01
457	600485	信威集团	1,800	48,150.00	0.01
458	300256	星星科技	1,900	47,842.00	0.01
459	300125	易世达	1,400	46,900.00	0.01
460	000719	大地传媒	2,200	44,880.00	0.01
461	002599	盛通股份	1,000	40,740.00	0.01
462	300313	天山生物	2,200	38,940.00	0.01
463	300376	易事特	800	38,408.00	0.01
464	002712	思美传媒	300	38,400.00	0.01
465	002580	圣阳股份	1,700	34,000.00	0.01
466	002728	台城制药	1,100	31,878.00	0.01
467	300360	炬华科技	900	31,590.00	0.01
468	300365	恒华科技	600	25,722.00	0.01

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	601169	北京银行	20,975,053.39	3.06

2	601318	中国平安	20,729,110.93	3.03
3	600030	中信证券	18,849,026.35	2.75
4	600837	海通证券	16,009,605.14	2.34
5	601601	中国太保	14,822,988.67	2.16
6	601166	兴业银行	12,777,269.18	1.87
7	600016	民生银行	11,318,692.12	1.65
8	600000	浦发银行	9,280,537.73	1.36
9	601328	交通银行	8,828,075.00	1.29
10	000001	平安银行	8,662,772.04	1.27
11	601788	光大证券	8,560,131.00	1.25
12	000838	财信发展	8,520,971.43	1.24
13	601398	工商银行	8,010,843.00	1.17
14	600048	保利地产	7,589,095.17	1.11
15	002562	兄弟科技	7,435,344.99	1.09
16	300173	智慧松德	7,347,019.58	1.07
17	601668	中国建筑	7,334,854.24	1.07
18	601989	中国重工	7,148,847.00	1.04
19	000002	万科 A	7,080,205.45	1.03
20	300043	互动娱乐	6,884,679.01	1.01

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	35,736,114.98	5.22
2	600837	海通证券	24,087,192.60	3.52
3	601166	兴业银行	23,824,755.25	3.48
4	600000	浦发银行	23,446,202.65	3.42
5	600016	民生银行	22,474,278.30	3.28
6	601169	北京银行	22,007,778.77	3.21
7	600030	中信证券	21,720,797.02	3.17
8	601668	中国建筑	21,057,248.32	3.07
9	601390	中国中铁	20,175,323.90	2.95
10	601988	中国银行	18,250,864.47	2.67
11	601818	光大银行	17,976,405.69	2.63

12	000776	广发证券	16,876,926.50	2.46
13	600015	华夏银行	16,236,940.76	2.37
14	600999	招商证券	15,620,327.32	2.28
15	601601	中国太保	14,952,533.82	2.18
16	601328	交通银行	14,306,020.45	2.09
17	000686	东北证券	14,249,034.12	2.08
18	601628	中国人寿	13,575,428.20	1.98
19	601336	新华保险	13,257,216.54	1.94
20	601800	中国交建	12,223,365.61	1.78

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	2,422,468,183.17
卖出股票收入（成交）总额	2,902,773,676.24

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。

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

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	174,806.74
2	应收证券清算款	1,656,947.62
3	应收股利	-
4	应收利息	10,949.21
5	应收申购款	4,176,860.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,019,564.46

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	000002	万科 A	3,354,239.00	0.74	临时停牌

§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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
14,466	20,753.70	30,710,391.69	10.23%	269,512,692.02	89.77%

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	156,948.12	0.0523%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 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	393,301,563.58
减：本报告期基金总赎回份额	830,246,961.13
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	300,223,083.71

§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，无涉及基金管理人、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

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)有限公司审计费用 55,000 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 6 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	
广发证券		12,804,046,053.60	52.67%	2,502,320.18	52.23%	-
银河证券		11,041,189,675.73	19.56%	953,866.14	19.91%	-
中投证券	1	903,289,781.77	16.97%	825,356.96	17.23%	-
华泰证券	2	566,990,218.34	10.65%	501,737.29	10.47%	-
华创证券	1	8,224,279.97	0.15%	7,487.40	0.16%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：专用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。

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	-	-	-	-	-	-
银河证券	34,584.00	3.66%	62,000,000.00	3.94%	-	-
中投证券	910,945.50	96.34%	1,511,000,000.00	96.06%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月18日
2	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月3日
3	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年11月26日

4	关于电子直销业务调整通联支付申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 23 日
5	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 10 日
6	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
7	南方基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购最低金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
8	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 6 日
9	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 5 日
10	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 20 日
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 16 日
12	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 15 日
13	关于公司旗下基金持有的“金亚科技”股票估值价格调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 9 日
14	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 27 日
15	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 26 日
16	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 25 日
17	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 22 日

18	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 11 日
19	南方基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称、基金类别并修改基金合同等相关条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 7 日
20	关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 7 日
21	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 4 日
22	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 28 日
23	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 24 日
24	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 15 日
25	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 15 日
26	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 14 日
27	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 10 日
28	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 9 日
29	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 8 日
30	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 7 日
31	关于公司旗下基金调整停牌股票	中国证券报、上海	2015 年 7 月 4 日

	估值方法的提示性公告	证券报、证券时报	
32	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 2 日
33	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 30 日
34	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 27 日
35	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 26 日
36	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 20 日
37	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 19 日
38	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 17 日
39	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 13 日
40	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 12 日
41	南方基金关于电子直销平台开通货币基金快速转购业务并实行 0 费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 8 日
42	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 6 日
43	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 3 日
44	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 27 日
45	关于公司旗下基金调整停牌股票	中国证券报、上海	2015 年 5 月 26 日

	估值方法的提示性公告	证券报、证券时报	
46	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 22 日
47	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 20 日
48	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 13 日
49	南方基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 7 日
50	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 28 日
51	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 23 日
52	关于电子直销业务增加苏宁易购第三方支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 15 日
53	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 14 日
54	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 11 日
55	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 10 日
56	南方基金关于淘宝直营店销售手续费费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 10 日
57	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 8 日
58	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 7 日
59	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 26 日

60	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 24 日
61	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 20 日
62	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 17 日
63	南方基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 17 日
64	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 5 日
65	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 28 日
66	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 12 日
67	南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 12 日
68	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 3 日
69	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 22 日
70	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 17 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方策略优化混合型证券投资基金的文件。
- 2、《南方策略优化混合型证券投资基金基金合同》

- 3、《南方策略优化混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《南方策略优化混合型证券投资基金 2015 年年度报告》原文
- 5、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>