

南方保本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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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	13
§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.....	14
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.....	14
§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.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§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.....	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46

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	46
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	46
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
8.12	投资组合报告附注	47
§9	基金份额持有人信息	48
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§10	开放式基金份额变动	48
§11	重大事件揭示	49
11.1	基金份额持有人大会决议	49
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	49
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
11.4	基金投资策略的改变	49
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
11.8	其他重大事件	51
§12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	57
12.3	查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方保本混合型证券投资基金
基金简称	南方保本混合
基金主代码	202212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月21日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	469,016,884.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金按照恒定比例投资组合保险机制进行资产配置，在确保保本期到期时本金安全的基础上，力争基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用恒定比例投资组合保险策略（Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI）来实现保本和增值的目标。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街69号
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	北京复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
邮政编码		518048	100031
法定代表人		吴万善	刘士余

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	深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司	北京市海淀区西三环北陆 100 号金玉大厦写字楼 9 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	135,020,104.73	122,008,943.14	119,070,811.57
本期利润	125,145,429.74	145,724,490.43	90,210,167.92
加权平均基金份额本期利润	0.2322	0.0895	0.0279
本期加权平均净值利润率	18.65%	8.31%	2.61%
本期基金份额净值增长率	19.44%	13.58%	2.66%
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	153,005,976.76	57,022,831.60	221,061,891.95
期末可供分配基金份额利润	0.3262	0.0855	0.0807
期末基金资产净值	622,514,431.85	740,946,928.02	2,961,839,491.43
期末基金份额净值	1.327	1.111	1.081
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	48.05%	23.96%	9.14%

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。

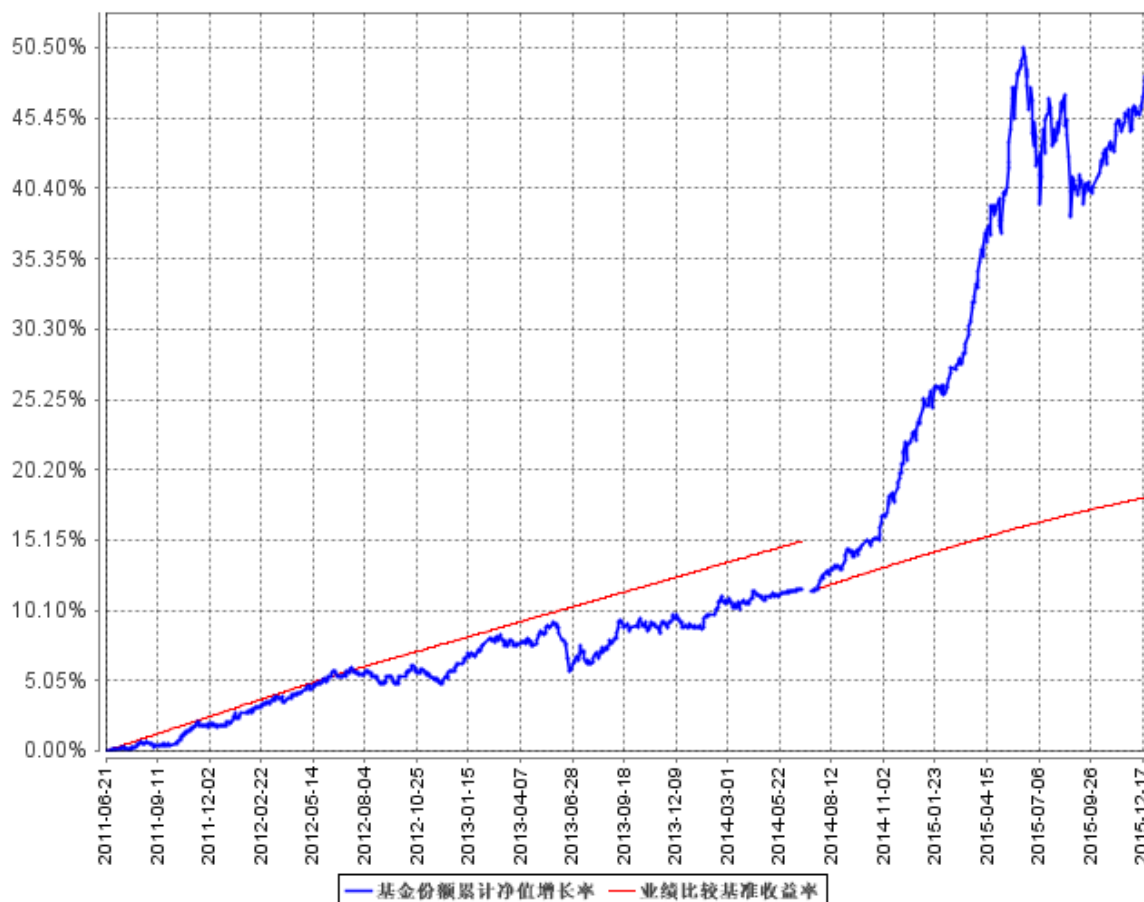
3.2 基金净值表现

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	5.40%	0.32%	0.83%	0.01%	4.57%	0.31%
过去六个月	2.00%	0.57%	1.76%	0.01%	0.24%	0.56%
过去一年	19.44%	0.54%	3.86%	0.01%	15.58%	0.53%
过去三年	39.27%	0.35%	13.54%	0.01%	25.73%	0.34%
自基金合同生效起至今	48.05%	0.29%	22.05%	0.01%	26.00%	0.28%

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

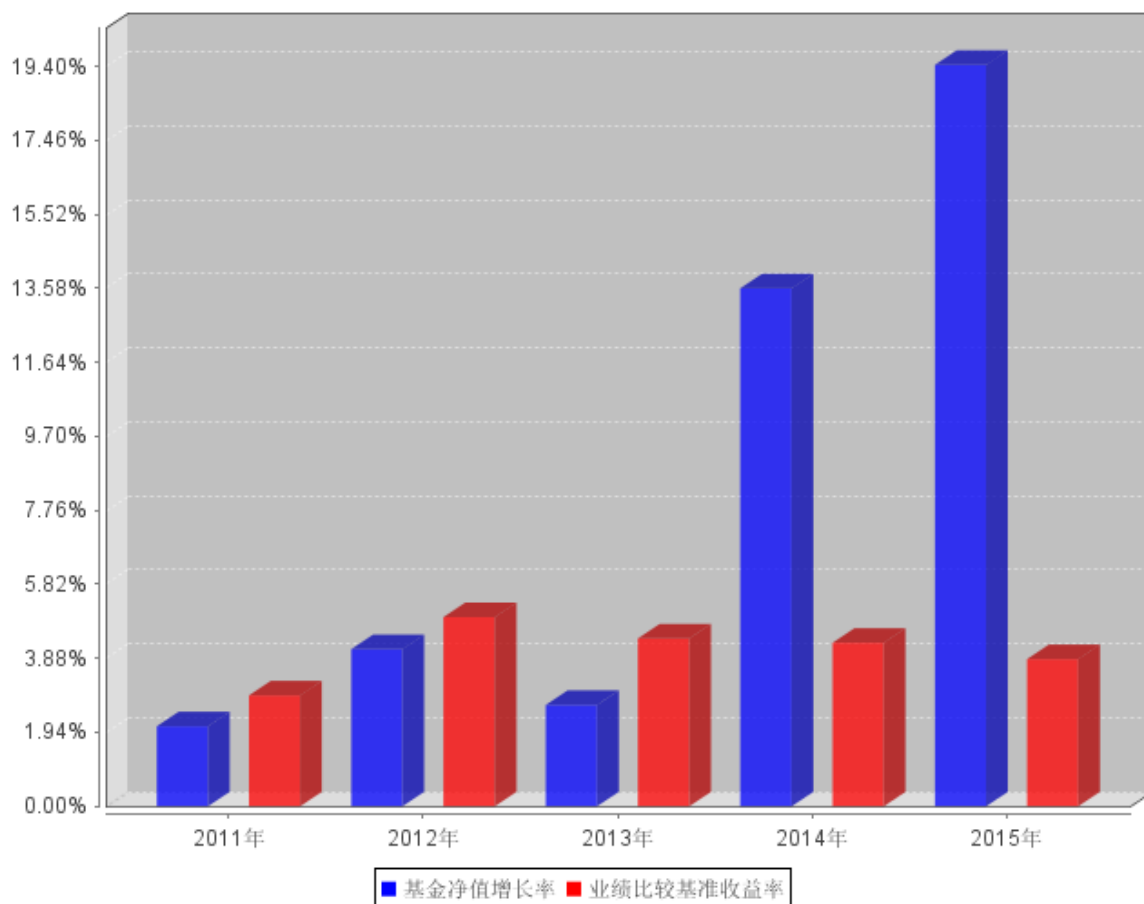
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的第一个保本期为三年，自 2011 年 6 月 21 日至 2014 年 6 月 23 日止；第二个保本期为三年，自 2014 年 7 月 11 日至 2017 年 7 月 11 日止。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 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	-	-	-	-	
2014	1.0200	254,617,591.10	-	254,617,591.10	
2013	-	-	-	-	
合计	1.0200	254,617,591.10	-	254,617,591.10	

§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		
孙鲁 闽	本基 金基 金经 理	2011 年 6月 21日	-	12年	南开大学理学和经济学双学士、澳大利亚新南威尔士大学商学硕士，具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行福州分行，2003年4月加入南方基金管理有限公司，历任行业研究员、南方高增和南方隆元的基金经理助理、专户投资管理部总监助理；2007年12月至2010年10月，担任南方基金企业年金和专户的投资经理。2010年12月至今，任南方避险基金经理；2011年6月至今，任南方保本基金经理；2015年4月至今，任南方利淘基金经理；2015年5月至今，任南方利鑫基金经理；2015年5月至今，任南方丰合基金经理；2015年12月至今，任南方瑞利保本基金经理。
黄春 逢	本基 金基 金经 理助 理	2015 年 4月 16日	2015 年 12 月 30日	4年	上海交通大学金融学硕士，具有基金从业资格。2011年7月至2014年12月，任职于国泰君安研究所，担任银行业分析师；2015年1月加入南方基金研究部，任金融行业高级研究员；2015年4月至2015年12月，任南方避险、南方保本、南方利淘的基金经理助理；2015年5月至2015年12月，任南方利鑫的基金经理助理；2015年6月

					至 2015 年 12 月，任南方丰合的基金经理助理； 2015 年 12 月至今，任南方成份基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方保本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，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 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 年国内宏观经济仍处于下行通道，预计全年 GDP 增速将回落至 6.9%，投资、消费、出口三驾马车增速全面回落。由于 2015 年物价水平维持在低位，在稳增长保就业的政策基调下，货币政策被赋予了较大的运用空间，上半年多次降准降息向市场注入了可观的流动性。下半年受制于美联储加息的预期，货币政策边际宽松的力度出现减弱，财政政策逐步发力确保稳增长政策配套的延续。

在杠杆效应的助推下，2015 年资本市场的巨幅波动充分反映了投资者对于经济、政策的预期的显著变化。上半年市场延续了 2014 年以来的牛市行情，上证综指一路站上 5178 高点，较年初涨幅 60%；创业板指更是达到 4037 点，较年初涨幅 174%，估值泡沫化行情已然出现。然而由杠杆资金推动的行情总是会酝酿更大的风险，在去杠杆的过程中市场也出现了罕见的非理性的调整。临近年末美联储加息落地，基于对货币政策进一步宽松落空以及对人民币汇率波动幅度加大的担忧，尽管四季度有超跌反弹，市场的风险偏好最终也出现了回落，上证综指最终收于 3539 点，较年初仅微涨 9%；创业板指收于 2714 点，较年初上涨 84%。受货币政策持续宽松的影响，2015 年债市走牛，上证国债指数上涨 6%，上证企债指数上涨 8.8%。

在 2015 年中，基于对市场估值泡沫化的判断，我们通过对权益仓位和持股结构的调整，最大程度减少了市场调整对组合净值的冲击。通过重点持有低估值高分红的蓝筹股，在市场利率中枢下行的背景下，全年取得了较好的绝对收益。同时组合也积极参与了新股、转债的申购，在市场巨幅震荡的环境中取得了一定的无风险收益。在债券配置上组合专注于投资中高评级债券，并适度降低了债券久期，在保证充分流动性的前提下获取稳定的持有至到期收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年度本基金的净值增长率为 19.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2016 年中国宏观经济仍将处于缓慢下行的通道。美国经济复苏叠加美联储加息周期开启将使得人民币出现一定的贬值压力，同时对国内货币政策进一步大幅宽松产生约束。预计市场流动性仍将保持相对充裕，但标志性的货币宽松手段如降息降准运用的概率正在阶段性下降。

展望 2016 年，权益市场直接融资步伐加快，大小非减持限制到期、注册制、新三板转板、战略新兴板等推出将加快股票供给。同时，预计 2016 年市场利率中枢仍将维持低位，资产荒大背景仍将持续。专注于绝对收益的中长线机构投资者提高权益类资产权重仍将是顺势而为，保险资金入市是第一波，银行理财产品则会成为第二波。未来诸如养老金、深港通、MSCI 纳入 A 股等增量资金均将加快入市步伐。经过 2015 年股债双牛，预计 2016 年股指将呈现宽幅震荡，信用风险也有可能结构性爆发，如何平衡风险与收益将是我们首要考虑的问题。我们将密切关注市场制度的改革，通过控制仓位和配置高分红、中低估值、持续成长的白马股来规避踏空及系统性回调的风险。在债券投资方面，我们将高度重视债券品种的选择，有可能在牺牲部分收益的前提下配置高评级的债券品种，同时加大可转债的投资力度。

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：本基金的每份基金份额享有同等分配权；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；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；本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资。转型为“南方平衡配置混合型证券投资基金”后，基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；法律法规或监管机构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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核

算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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 21266 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	南方保本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保本混合型证券投资基金(以下简称“南方保本基金”)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保本基金 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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
审计意见段	我们认为，上述南方保本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、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，公允反映了南方保本基金 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。
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：南方保本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	5,020,772.94	1,818,310.35
结算备付金		3,067,520.78	3,765,571.10

存出保证金		179,582.37	177,218.32
交易性金融资产	7.4.7.2	644,016,688.77	730,766,007.64
其中：股票投资		111,282,545.87	107,932,810.70
基金投资		-	-
债券投资		532,734,142.90	622,833,196.94
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	-	70,000,425.00
应收证券清算款		179,998,917.06	4,591,836.94
应收利息	7.4.7.5	12,675,357.15	14,932,914.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		844,958,839.07	826,052,283.91
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		219,000,000.00	78,699,805.00
应付证券清算款		2,270,904.40	-
应付赎回款		-	4,787,720.04
应付管理人报酬		633,274.48	766,704.30
应付托管费		105,545.74	127,784.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	252,861.59	249,575.95
应交税费		-	-
应付利息		9,821.01	167,609.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	172,000.00	306,157.48
负债合计		222,444,407.22	85,105,355.89
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	467,709,302.34	664,822,040.40
未分配利润	7.4.7.10	154,805,129.51	76,124,887.62
所有者权益合计		622,514,431.85	740,946,928.02
负债和所有者权益总计		844,958,839.07	826,052,283.91

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.327 元，基金份额总额 469,016,884.41 份。

7.2 利润表

会计主体：南方保本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		141,914,535.82	184,085,111.15
1. 利息收入		25,745,208.24	68,810,227.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	556,058.29	9,420,287.01
债券利息收入		24,964,991.59	49,279,430.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		224,158.36	10,110,510.71
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		125,464,652.47	89,886,755.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	119,794,283.93	40,496,164.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,453,309.11	47,952,244.92
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,217,059.43	1,438,345.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-9,874,674.99	23,715,547.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	579,350.10	1,672,581.00
减：二、费用		16,769,106.08	38,360,620.72
1. 管理人报酬		8,054,674.98	20,951,415.34
2. 托管费		1,342,445.75	3,491,902.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,055,301.18	2,347,224.17
5. 利息支出		4,891,197.52	11,077,482.93
其中：卖出回购金融资产支出		4,891,197.52	11,077,482.93
6. 其他费用	7.4.7.19	425,486.65	492,595.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		125,145,429.74	145,724,490.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		125,145,429.74	145,724,490.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	664,822,040.40	76,124,887.62	740,946,928.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	125,145,429.74	125,145,429.74
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）	-197,112,738.06	-46,465,187.85	-243,577,925.91
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-197,112,738.06	-46,465,187.85	-243,577,925.91
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）	467,709,302.34	154,805,129.51	622,514,431.85
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）	2,740,777,599.48	221,061,891.95	2,961,839,491.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	145,724,490.43	145,724,490.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,075,955,559.08	-36,043,903.66	-2,111,999,462.74
其中：1. 基金申购款	121,096,504.02	350,081.73	121,446,585.75
2. 基金赎回款	-2,197,052,063.10	-36,393,985.39	-2,233,446,048.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变	-	-254,617,591.10	-254,617,591.10

动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	664,822,040.40	76,124,887.62	740,946,928.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方保本混合型证券投资基金(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[2011]第 524 号《关于核准南方保本混合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《南方保本混合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 4,957,089,273.27 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(2011)第 213 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,960,661,163.34 份基金份额,其中认购资金利息折合 3,571,890.07 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司,担保人为中国投融资担保股份有限公司(原中国投资担保有限公司)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金可以投资于股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%;债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%;现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的投资目标为在严格控制风险的前提下,为投资者提供认购保本金额的保证,并在此基础上力争基金资产的稳定增值。在保本期到期日,如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额,则基金管理人补足该差额,并由担保人提供不可撤销的连带责任担保。本基金的业绩比较基准为:3 年期银行定期存款税后收益率+0.5%。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金的保本期安排列示如下：

保本年到期日	份额数	最大保本线	截止 2015 年 12 月 31 日基金份额净值
2017 年 7 月 11 日	469,016,884.41	1.000	1.327

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》、《南方保本混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相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和债券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。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定

公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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	5,020,772.94	1,818,310.35
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计：	5,020,772.94	1,818,310.35

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	106,480,033.81	111,282,545.87	4,802,512.06	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	311,187,528.26	318,768,142.90	7,580,614.64
	银行间市场	209,952,663.83	213,966,000.00	4,013,336.17
	合计	521,140,192.09	532,734,142.90	11,593,950.81
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	627,620,225.90	644,016,688.77	16,396,462.87	
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	84,679,658.89	107,932,810.70	23,253,151.81	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	299,440,924.44	301,418,196.94	1,977,272.50
	银行间市场	320,374,286.45	321,415,000.00	1,040,713.55
	合计	619,815,210.89	622,833,196.94	3,017,986.05

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	704,494,869.78	730,766,007.64	26,271,137.86

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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
交易所买入返售金融资产	-	-
银行间买入返售金融资产	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售金融资产	-	-
银行间买入返售金融资产	70,000,425.00	-
合计	70,000,425.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

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	24,416.86	8,915.65
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	1,380.40	1,694.50
应收债券利息	12,649,479.09	14,790,694.65
应收买入返售证券利息	-	131,530.06
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	80.80	79.70

合计	12,675,357.15	14,932,914.56
----	---------------	---------------

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015年12月31日	2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	250,786.59	246,569.63
银行间市场应付交易费用	2,075.00	3,006.32
合计	252,861.59	249,575.95

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015年12月31日	2014年12月31日
预提费用	172,000.00	300,000.00
应付赎回费	-	6,157.48
合计	172,000.00	306,157.48

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	666,661,788.54	664,822,040.40
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-197,644,904.13	-197,112,738.06
本期末	469,016,884.41	467,709,302.34

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	57,022,831.60	19,102,056.02	76,124,887.62
本期利润	135,020,104.73	-9,874,674.99	125,145,429.74
本期基金份额交易	-39,036,959.57	-7,428,228.28	-46,465,187.85

产生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-39,036,959.57	-7,428,228.28	-46,465,187.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	153,005,976.76	1,799,152.75	154,805,129.51

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	497,171.84	882,785.09
定期存款利息收入	-	8,369,609.58
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	56,972.69	164,024.91
其他	1,913.76	3,867.43
合计	556,058.29	9,420,287.01

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	714,989,387.47	861,333,475.50
减：卖出股票成本总额	595,195,103.54	820,837,310.87
买卖股票差价收入	119,794,283.93	40,496,164.63

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	257,558,426.84	3,910,550,552.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	247,003,177.09	3,780,269,948.01
减：应收利息总额	7,101,940.64	82,328,359.22
买卖债券差价收入	3,453,309.11	47,952,244.92

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 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	2,217,059.43	1,438,345.49
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,217,059.43	1,438,345.49

7.4.7.16 公允价值变动收益

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
1. 交易性金融资产	-9,874,674.99	23,715,547.29
——股票投资	-18,450,639.75	17,658,798.23
——债券投资	8,575,964.76	6,056,749.06
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-9,874,674.99	23,715,547.29

7.4.7.17 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	545,666.16	1,672,581.00
其他	33,683.94	-
合计	579,350.10	1,672,581.00

注：根据《南方保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，在保本周期到期前赎回费率随申请份额持有时间增加而递减，赎回费归入基金资产的比例不得低于50%。

7.4.7.18 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	2,052,201.18	2,325,674.17
银行间市场交易费用	3,100.00	21,550.00
合计	2,055,301.18	2,347,224.17

7.4.7.19 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
信息披露费	300,000.00	300,000.00
审计费用	63,000.00	91,000.00
帐户维护费	36,450.00	67,600.00
银行费用	25,936.65	33,595.71
其他	100.00	400.00
合计	425,486.65	492,595.71

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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	484,489,409.69	36.61%	179,114,381.40	12.56%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	430,124.95	35.92%	-	-
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	158,183.82	12.31%	99,146.92	40.21%

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。

7.4.10.2 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	8,054,674.98	20,951,415.34
其中：支付销售机构的客户维护费	2,579,755.71	6,879,203.37

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 1.20% 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 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	1,342,445.75	3,491,902.57

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

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

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
中国农业银行	-	-	-	-	40,000,000.00	23,423.84
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
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

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

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

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：于本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 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
中国农业银行	5,020,772.94	497,171.84	1,818,310.35	882,785.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未进行利润分配。

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**

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。

7.4.12.2 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
600168	武汉控股	2015年10月8日	重大资产重组	9.68	-	-	80,000	1,014,426.62	774,400.00	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 219,000,000.00 元，2016 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金是一只保本型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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在确保保本期到期时本金安全的基础上，力争基金资产的稳定增值。

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、风险管理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险管理部负责，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中国农业银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 79.14%(2014 年 12 月 31 日：77.30%)。

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。本基金持有一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持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，以合理的价格适时变现。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，除卖出回购金融资产款余额中有 219,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	5,020,772.94	-	-	-	5,020,772.94
结算备付金	3,067,520.78	-	-	-	3,067,520.78
存出保证金	179,582.37	-	-	-	179,582.37
交易性金融资产	335,251,533.60	197,482,609.30	-	111,282,545.87	644,016,688.77
应收证券清算款	-	-	-	179,998,917.06	179,998,917.06
应收利息	-	-	-	12,675,357.15	12,675,357.15
资产总计	343,519,409.69	197,482,609.30	-	303,956,820.08	844,958,839.07
负债					
卖出回购金融资产款	219,000,000.00	-	-	-	219,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,270,904.40	2,270,904.40
应付管理人报酬	-	-	-	633,274.48	633,274.48
应付托管费	-	-	-	105,545.74	105,545.74
应付交易费用	-	-	-	252,861.59	252,861.59

应付利息	-	-	-	9,821.01	9,821.01
其他负债	-	-	-	172,000.00	172,000.00
负债总计	219,000,000.00	0.00	-	3,444,407.22	222,444,407.22
利率敏感度缺口	124,519,409.69	197,482,609.30	-	300,512,412.86	622,514,431.85
上年度末 2014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	1,818,310.35	-	-	-	1,818,310.35
结算备付金	3,765,571.10	-	-	-	3,765,571.10
存出保证金	177,218.32	-	-	-	177,218.32
交易性金融资产	271,527,665.50	350,268,523.20	1,037,008.24	107,932,810.70	730,766,007.64
买入返售金融资产	70,000,425.00	-	-	-	70,000,425.00
应收证券清算款	-	-	-	4,591,836.94	4,591,836.94
应收利息	-	-	-	14,932,914.56	14,932,914.56
资产总计	347,289,190.27	350,268,523.20	1,037,008.24	127,457,562.20	826,052,283.91
负债					
卖出回购金融资产款	78,699,805.00	-	-	-	78,699,805.00
应付赎回款	-	-	-	4,787,720.04	4,787,720.04
应付管理人报酬	-	-	-	766,704.30	766,704.30
应付托管费	-	-	-	127,784.06	127,784.06
应付交易费用	-	-	-	249,575.95	249,575.95
应付利息	-	-	-	167,609.06	167,609.06
其他负债	-	-	-	306,157.48	306,157.48
负债总计	78,699,805.00	-	-	6,405,550.89	85,105,355.89
利率敏感度缺口	268,589,385.27	350,268,523.20	1,037,008.24	121,052,011.31	740,946,928.02

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

假设	除市场利率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）
	市场利率下降 25 个基点	增加约 137	增加约 209
市场利率上升 25 个基点	减少约 136	减少约 208	

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。本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。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	111,282,545.87	17.88	107,932,810.70	14.57
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	111,282,545.87	17.88	107,932,810.70	14.57

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 17.88% (2014 年 12 月 31 日：14.57%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2014 年 12 月 31 日：同)。

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 111,340,311.47 元，属于第二层次的余额为 532,676,377.30 元，无属于第三层次的余额 (2014 年 12 月 31 日：第一层次 407,785,007.64 元，第二层次

322,981,000.00 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

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	111,282,545.87	13.17
	其中：股票	111,282,545.87	13.17
2	固定收益投资	532,734,142.90	63.05
	其中：债券	532,734,142.90	63.05
	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	8,088,293.72	0.96
7	其他各项资产	192,853,856.58	22.82
8	合计	844,958,839.07	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	52,753,472.08	8.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,609,400.00	0.26
E	建筑业	8,985,259.00	1.44
F	批发和零售业	6,687,313.91	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	4,279,600.00	0.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,146,333.38	0.34
J	金融业	23,280,812.39	3.74
K	房地产业	5,677,500.00	0.91
L	租赁和商务服务业	767,000.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.02
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	4,986,462.90	0.80
S	综合	-	-
	合计	111,282,545.87	17.88

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	601166	兴业银行	850,023	14,509,892.61	2.33
2	000895	双汇发展	530,122	10,819,790.02	1.74
3	000333	美的集团	150,000	4,923,000.00	0.79
4	000418	小天鹅A	201,500	4,836,000.00	0.78
5	600885	宏发股份	130,739	3,907,788.71	0.63
6	600068	葛洲坝	450,000	3,541,500.00	0.57
7	600266	北京城建	230,000	3,367,200.00	0.54
8	601098	中南传媒	130,011	3,107,262.90	0.50
9	000001	平安银行	250,950	3,008,890.50	0.48
10	000625	长安汽车	170,000	2,884,900.00	0.46
11	000961	中南建设	180,900	2,796,714.00	0.45
12	600511	国药股份	70,000	2,654,400.00	0.43
13	601169	北京银行	250,000	2,632,500.00	0.42
14	002304	洋河股份	30,000	2,056,200.00	0.33
15	002454	松芝股份	100,400	1,926,676.00	0.31
16	600519	贵州茅台	8,800	1,920,072.00	0.31
17	600373	中文传媒	80,000	1,879,200.00	0.30
18	600020	中原高速	250,000	1,710,000.00	0.27
19	000999	华润三九	60,000	1,638,000.00	0.26
20	600660	福耀玻璃	100,000	1,519,000.00	0.24
21	600409	三友化工	190,000	1,472,500.00	0.24
22	002047	宝鹰股份	130,000	1,461,200.00	0.23
23	600185	格力地产	60,000	1,274,400.00	0.20
24	000828	东莞控股	100,000	1,270,000.00	0.20
25	000783	长江证券	100,000	1,242,000.00	0.20
26	601607	上海医药	59,917	1,192,947.47	0.19
27	603766	隆鑫通用	50,000	1,186,500.00	0.19
28	601668	中国建筑	180,000	1,141,200.00	0.18
29	002029	七匹狼	80,000	1,093,600.00	0.18
30	000860	顺鑫农业	50,000	1,065,000.00	0.17
31	000997	新大陆	40,000	1,012,800.00	0.16
32	600327	大东方	100,000	1,001,000.00	0.16
33	002557	洽洽食品	50,150	938,808.00	0.15
34	600761	安徽合力	70,029	934,887.15	0.15

35	002508	老板电器	20,000	899,000.00	0.14
36	603669	灵康药业	25,000	872,250.00	0.14
37	000882	华联股份	150,000	856,500.00	0.14
38	002701	奥瑞金	30,000	847,800.00	0.14
39	600741	华域汽车	50,000	843,000.00	0.14
40	600886	国投电力	100,000	835,000.00	0.13
41	600697	欧亚集团	20,000	828,800.00	0.13
42	002025	航天电器	30,000	779,700.00	0.13
43	600168	武汉控股	80,000	774,400.00	0.12
44	002344	海宁皮城	50,000	767,000.00	0.12
45	002042	华孚色纺	60,000	723,000.00	0.12
46	601006	大秦铁路	80,000	689,600.00	0.11
47	002368	太极股份	10,000	671,000.00	0.11
48	603936	博敏电子	12,448	638,333.44	0.10
49	002152	广电运通	20,000	619,800.00	0.10
50	601021	春秋航空	10,000	610,000.00	0.10
51	600080	金花股份	40,000	573,200.00	0.09
52	002250	联化科技	30,030	566,666.10	0.09
53	000858	五粮液	20,000	545,600.00	0.09
54	601009	南京银行	30,000	531,000.00	0.09
55	000750	国海证券	40,100	515,285.00	0.08
56	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.08
57	002142	宁波银行	31,028	481,244.28	0.08
58	002441	众业达	20,000	443,000.00	0.07
59	603001	奥康国际	12,600	423,612.00	0.07
60	600809	山西汾酒	20,000	385,400.00	0.06
61	002534	杭锅股份	19,700	380,604.00	0.06
62	601318	中国平安	10,000	360,000.00	0.06
63	002336	人人乐	23,800	344,862.00	0.06
64	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.05
65	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.04
66	000036	华联控股	20,000	179,400.00	0.03
67	300494	盛天网络	6,251	162,901.06	0.03
68	300492	山鼎设计	6,219	109,392.21	0.02
69	300495	美尚生态	500	44,645.00	0.01
70	603866	桃李面包	1,000	38,610.00	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	000543	皖能电力	18,780,254.08	2.53
2	600068	葛洲坝	14,348,840.00	1.94
3	601939	建设银行	13,152,754.00	1.78
4	000895	双汇发展	12,332,278.16	1.66
5	000001	平安银行	12,065,958.30	1.63
6	600780	通宝能源	11,169,695.01	1.51
7	601166	兴业银行	9,688,881.00	1.31
8	600000	浦发银行	9,082,550.00	1.23
9	000418	小天鹅 A	8,353,833.86	1.13
10	601318	中国平安	7,729,500.00	1.04
11	600697	欧亚集团	7,694,750.68	1.04
12	600885	宏发股份	6,925,698.88	0.93
13	601098	中南传媒	6,910,625.50	0.93
14	600036	招商银行	6,714,192.22	0.91
15	600894	广日股份	6,622,916.10	0.89
16	603008	喜临门	6,517,557.27	0.88
17	600987	航民股份	6,469,049.15	0.87
18	600373	中文传媒	6,413,539.93	0.87
19	000002	万科 A	5,516,124.95	0.74
20	000961	中南建设	5,451,684.00	0.74

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	000543	皖能电力	26,993,374.79	3.64
2	600000	浦发银行	17,405,691.01	2.35
3	601006	大秦铁路	15,982,129.18	2.16
4	300070	碧水源	15,317,376.04	2.07

5	601939	建设银行	13,898,917.22	1.88
6	600780	通宝能源	13,169,770.29	1.78
7	600068	葛洲坝	12,569,310.84	1.70
8	600887	伊利股份	10,596,445.16	1.43
9	601877	正泰电器	9,792,986.41	1.32
10	000001	平安银行	9,386,910.46	1.27
11	601166	兴业银行	9,321,490.00	1.26
12	601318	中国平安	8,428,363.00	1.14
13	600987	航民股份	8,362,871.42	1.13
14	600894	广日股份	8,172,684.62	1.10
15	603008	喜临门	8,035,638.60	1.08
16	002250	联化科技	7,233,840.31	0.98
17	600697	欧亚集团	7,212,345.50	0.97
18	600036	招商银行	7,175,471.00	0.97
19	600373	中文传媒	7,079,170.23	0.96
20	002630	华西能源	6,871,179.00	0.93

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	616,995,478.46
卖出股票收入（成交）总额	714,989,387.47

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,048,000.00	6.43
	其中：政策性金融债	40,048,000.00	6.43
4	企业债券	328,032,977.30	52.69
5	企业短期融资券	30,165,000.00	4.85
6	中期票据	133,656,000.00	21.47
7	可转债（可交换债）	832,165.60	0.13
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	532,734,142.90	85.58

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	122923	10 北汽投	410,150	42,032,172.00	6.75
2	1382116	13 北国资 MTN1	400,000	41,892,000.00	6.73
3	122068	11 海螺 01	400,000	40,328,000.00	6.48
4	150202	15 国开 02	400,000	40,048,000.00	6.43
5	122154	12 京能 02	350,010	35,921,526.30	5.77

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

（1）利用股指期货调整风险资产的比例

本基金管理人将根据 CPPI 策略与市场的变化不断调整风险资产和安全资产之间的比例。在需要调整风险资产的头寸时，本基金将适当通过买卖股指期货对风险资产头寸进行调整。当需要

增加风险资产头寸时，可根据相应的 β 值建立股指期货多头头寸；反之，当需要降低风险资产头寸时，可根据相应的 β 值建立股指期货空头头寸。

(2) 调整投资组合的 β 值

风险资产的 β 值是决定组合表现的重要因素，基金管理人将通过在弱市中降低风险资产组合的 β 值，在强市中提高风险资产组合的 β 值，以提升组合的业绩表现。基金管理人将通过建立多头或者空头股指期货头寸实现对风险资产组合 β 值的控制。

(3) α 策略

在投资组合中分离出系统风险，寻求具有长期稳定的超额收益的投资品种，并利用股指期货规避系统风险。

本基金管理人正式投资股指期货前将与担保人协商确定股指期货相关风险控制流程。本基金的股指期货投资将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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	179,582.37
2	应收证券清算款	179,998,917.06
3	应收股利	-
4	应收利息	12,675,357.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	192,853,856.58

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
9,703	48,337.31	9,092,382.25	1.94%	459,924,502.16	98.06%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,166,387.48	0.2487%

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	0~10
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 (2011 年 6 月 21 日) 基金份额总额	4,960,661,163.34
本报告期期初基金份额总额	666,661,788.54
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	197,644,904.13
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以 "-" 填列)	-
本报告期末基金份额总额	469,016,884.41

§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 63,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 5 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	
华泰证券	1	484,489,409.69	36.61%	430,124.95	35.92%	-
英大证券	1	414,071,686.87	31.29%	376,948.21	31.48%	-
招商证券	1	159,735,165.56	12.07%	145,566.70	12.16%	-
国泰君安	1	122,116,003.25	9.23%	112,730.66	9.41%	-

中天证券	1	118,941,819.94	8.99%	109,808.90	9.17%	-
东方证券	1	23,987,148.67	1.81%	22,338.72	1.87%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	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
华泰证券	1,192,664.00	1.66%	-	-	-	-
英大证券	21,856,841.91	30.42%	2,992,800,000.00	42.96%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	23,660,075.85	32.93%	876,300,000.00	12.58%	-	-
中天证券	25,141,633.63	34.99%	1,890,200,000.00	27.13%	-	-
东方证券	-	-	1,207,100,000.00	17.33%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司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。

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	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
2	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年2月25日
3	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
4	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
5	南方基金关于旗下部分基金增加联泰资产为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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3月23日
6	南方基金关于旗下部分基金增加西安银行为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年3月23日
7	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
8	南方基金关于旗下部分基金增加	中国证券报、上海	2015年3月27日

	苏州银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
9	南方基金关于旗下部分基金增加增财基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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3月31日
10	南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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8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4月8日
12	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
13	关于电子直销业务增加苏宁易付宝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
14	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4月18日
15	南方基金管理有限公司关于公司高级管理人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月23日
16	南方基金管理有限公司深圳分公司负责人等信息变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月28日
17	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
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5月12日

19	南方基金关于旗下部分基金增加华融湘江银行为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 15 日
20	南方基金关于旗下部分基金增加汇付金融为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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 5 月 18 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 5 月 26 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 5 月 27 日
23	南方基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 29 日
24	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
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 6 月 17 日
26	南方基金关于旗下部分基金增加深圳农村商业银行、天津银行、威海市商业银行、厦门银行、顺德农村商业银行和东莞农村商业银行作为代销机构及开通定投、转换业务并参与其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 7 月 1 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 8 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 10 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 14 日
31	南方基金关于旗下部分基金增加厦门鑫鼎盛为代销机构及开通定投业务并参与其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 7 月 20 日
32	南方基金关于旗下部分基金增加龙江银行为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 22 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 7 月 24 日
34	南方基金关于旗下部分基金增加天风证券为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 31 日
35	南方基金关于旗下部分基金增加中信建投期货为代销机构及通定投和转换业务并参与其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 8 月 3 日
36	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
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 8 月 22 日
38	南方基金关于旗下部分基金增加陆金所资管为代销机构并参与其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 9 月 1 日
39	南方基金管理有限公司关于公司旗下开放式基金变更代销机构的	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 12 日

	公告		
40	南方基金关于旗下部分基金增加中经北证为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 21 日
41	南方基金关于旗下部分基金增加中信期货为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 23 日
42	南方基金关于旗下部分基金增加积木基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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 9 月 30 日
43	南方基金关于旗下部分基金增加桂林银行为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 15 日
44	南方基金关于旗下部分基金增加新浪仓石为代销机构并参与其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 10 月 16 日
45	南方基金关于旗下部分基金增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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 10 月 16 日
46	南方基金关于旗下部分基金增加泉州银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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 11 月 4 日
47	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
48	关于电子直销业务调整通联支付	中国证券报、上海	2015 年 11 月 23 日

	申购优惠费率的公告	证券报、证券时报	
49	南方基金关于旗下部分基金增加长安银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 23 日
50	南方基金关于旗下部分基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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 11 月 24 日
51	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 12 月 4 日
52	南方基金关于旗下部分基金增加凯石财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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 12 月 8 日
53	南方基金关于旗下部分基金增加锦州银行为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 9 日
54	南方基金关于旗下部分基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其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 12 月 11 日
55	南方基金关于旗下部分基金增加济安财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其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 12 月 17 日
56	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 12 月 29 日
57	南方基金关于旗下部分基金增加	中国证券报、上海	2015 年 12 月 30 日

	乐清农商银行作为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
--	-------------------------------------	----------	--

§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保本混合型证券投资基金的文件。
- 2、南方保本混合型证券投资基金基金合同。
- 3、南方保本混合型证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>