

南方大数据 100 指数证券投资基金 2015 年 半年度报告 摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 04 月 24 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方大数据 100 指数
基金主代码	001113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 24 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,135,681,826.60 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 6%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	大数据 100 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	蒋松云
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 4 月 24 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,176,256,926.26
本期利润	-2,160,818,196.77
加权平均基金份额本期利润	-0.3782
本期基金份额净值增长率	1.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1172
期末基金资产净值	10,276,518,907.59
期末基金份额净值	1.0139

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。

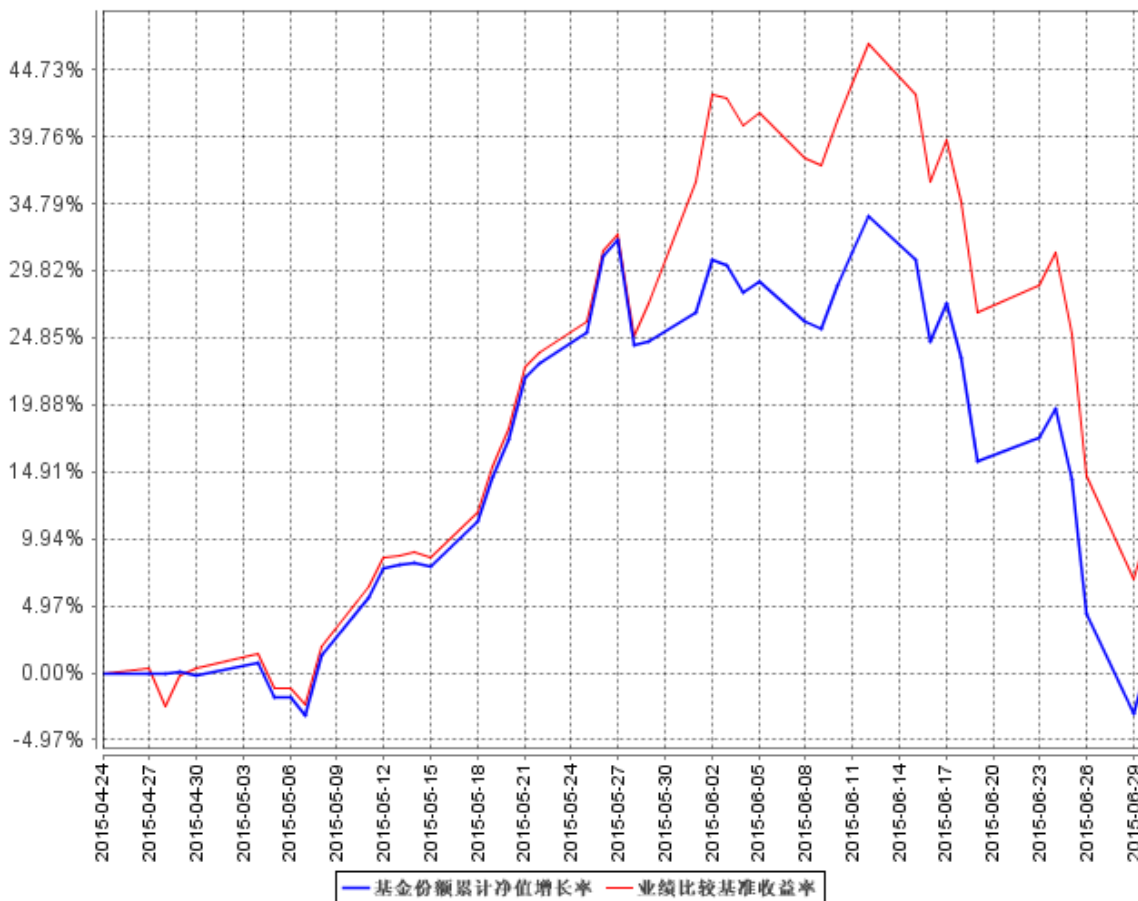
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-18.62%	3.68%	-12.78%	4.04%	-5.84%	-0.36%
自基金合同生效起至今	1.39%	3.13%	11.18%	3.31%	-9.79%	-0.18%

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：基金合同生效日至本报告期末不满一年，本基金建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

南方基金总部设在深圳，注册资本 3 亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司(45%)；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 3,500 亿元，旗下管理 73 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
雷俊	本基金基金经理	2015 年 4 月 24 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。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方大数据 100 指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 4 次，其中 3 次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致，1 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，市场波动较大，本基金严格按照指数投资管理流程进行运作，在募集完成的 4 月底快速完成了大部分的建仓工作。并于 5 月底开放申赎，本基金在实际运作时采用指令批量交易、算法交易多种交易手段，力争在申购赎回时降低交易成本和跟踪误差。同时，为了更好的管理流动性，根据基金的每期的成份股持仓情况，基金在适当条件采用部分股指期货投资替代。

本基金是基于互联网用户行为分析的一只股票指数基金，由于指数编制中有一部分互联网用户行为数据分析，其多变性某些时候会导致指数成份股的变化较大。随着时间的不断累积，越来越多的用户行为数据积累将有利于模型的优化和改善；同时随着 IPO 的放开和注册制的临近，量化大数据选股的优势将得到更多的体现。我们对未来该指数编制的数量化模型充满信心。

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 1.0139 元；报告期内，基金份额净值增长率为 1.3900%，同期业绩基准增长率为 11.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前看，A 股已经经历过一轮大幅的调整，市场风险充分释放。底部基本探明，经过底部充分震荡、去杠杆之后，慢牛行情会走的更稳健。另一方面，在上半年经济指标下滑、政策托底经济背景下，货币政策可能持续宽松；同时近期的市场调整使得投资者对于风险收益的认知度不断提高，这将有助于股票市场健康平稳发展；另外，居民资产配置转移长期趋势仍未改变，预计中长期看仍有一定的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，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，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金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；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利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；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；

每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——中国工商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方大数据 100 指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产		本期末 2015 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款		1,430,202,737.26
结算备付金		17,725,469.10
存出保证金		2,865,219.26
交易性金融资产		9,500,599,573.35
其中：股票投资		9,500,599,573.35
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		854,428,820.01
应收利息		217,554.13
应收股利		-
应收申购款		22,409,897.75
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		11,828,449,270.86
负债和所有者权益		本期末 2015 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,052,957,914.04
应付赎回款		486,468,047.94
应付管理人报酬		5,688,083.05
应付托管费		1,137,616.63
应付销售服务费		-
应付交易费用		3,499,601.76
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		2,179,099.85
负债合计		1,551,930,363.27
所有者权益：		
实收基金		10,135,681,826.60
未分配利润		140,837,080.99
所有者权益合计		10,276,518,907.59
负债和所有者权益总计		11,828,449,270.86

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0139 元，基金份额总额 10,135,681,826.60 份。

本基金自基金合同生效日（2015 年 4 月 24 日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.2 利润表

会计主体：南方大数据 100 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	
	2015 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日	
一、收入		-2,137,803,663.62
1.利息收入		1,526,127.06
其中：存款利息收入		1,350,959.21
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		175,167.85
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,157,716,122.81
其中：股票投资收益		-1,030,461,855.50
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-144,810,600.00
股利收益		17,556,332.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-984,561,270.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-

列)		
5.其他收入(损失以“-”号填列)		2,947,602.64
减: 二、费用		23,014,533.15
1. 管理人报酬		6,615,396.42
2. 托管费		1,323,079.29
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		14,730,449.89
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		345,607.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,160,818,196.77
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,160,818,196.77

注: 本基金自基金合同生效日(2015年4月24日)至报告期末不满一年, 无上年度对比数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方大数据 100 指数证券投资基金

本报告期: 2015 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-2,160,818,196.77	-2,160,818,196.77
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)	10,135,681,826.60	2,301,655,277.76	12,437,337,104.36
其中: 1. 基金申购款	12,102,731,729.53	2,692,629,524.41	14,795,361,253.94
2. 基金赎回款	-1,967,049,902.93	-390,974,246.65	-2,358,024,149.58
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）	10,135,681,826.60	140,837,080.99	10,276,518,907.59

注：本基金自基金合同生效日（2015 年 4 月 24 日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方大数据 100 指数证券投资基金(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[2015]279 号《关于核准南方大数据 100 指数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《南方大数据 100 指数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，首次设立募集人民币 991,441,210.52 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(2015)第 373 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方大数据 100 指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 991,441,210.52 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方大数据 100 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（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（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金 80%以上的基金资产投资于股票。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 85%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：大数据 100 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率（税后） \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2015 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方大数据 100 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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其他各类应付款项等。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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,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、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)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。

(4)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),按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年4月24日(基金合同生效日)至2015年6月30日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	9,988,958,164.29	34.35%

注：本基金自基金合同生效日（2015年4月24日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年4月24日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	1,512,792.58	43.23%	-	-

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。

3. 本基金自基金合同生效日（2015年4月24日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月24日(基金合同生效日)至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	2,536,042.81

注：支付基金管理人南方基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1% 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% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月24日(基金合同生效日)至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，每日计提，按月支付。托管费的计算方法如下：

每日应计提的基金托管费 = 前一日的基金资产净值 × 0.20% ÷ 当年天数

6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,430,202,737.26	1,350,549.44

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金自基金合同生效日（2015 年 4 月 24 日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300487	蓝晓科技	2015年6月24日	2015年7月2日	新股流通受限	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00	-
300489	中飞股份	2015年6月24日	2015年7月1日	新股流通受限	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601111	中国国航	2015年6月30日	重大事项	15.36	2015年7月29日	13.78	9,218,425	107,644,040.68	141,595,008.00	-
002706	良信电器	2015年6月19日	重大事项	65.20	2015年7月7日	58.68	2,135,349	124,848,061.09	139,224,754.80	-
002546	新联电子	2015年6月17日	重大事项	33.16	2015年7月16日	29.84	4,004,876	137,210,137.14	132,801,688.16	-
002498	汉缆股份	2015年6月30日	重大事项	20.57	2015年7月20日	22.63	5,976,407	122,908,320.56	122,934,691.99	-
300346	南大光电	2015年6月25日	重大事项	35.49	-	-	3,102,481	121,292,506.45	110,107,050.69	-
300084	海默科技	2015年6月3日	重大事项	21.43	2015年7月20日	19.29	4,764,008	98,489,743.96	102,092,691.44	-
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事项	37.76	2015年7月13日	34.65	2,608,650	111,443,817.55	98,502,624.00	-
002374	丽鹏股份	2015年6月30日	重大事项	23.34	2015年7月13日	22.50	3,872,468	117,851,188.13	90,383,403.12	-
300353	东土科技	2015年6月3日	重大事项	76.22	-	-	585,891	38,598,598.72	44,656,612.02	-
002703	浙江世宝	2015年5月	重大事项	52.01	-	-	254,471	9,250,186.79	13,235,036.71	-

		29 日								
300190	维尔利	2015 年 5 月 25 日	重大 事项	34.34	-	-	379,512	9,568,849.14	13,032,442.08	-
000665	湖北广电	2015 年 5 月 25 日	重大 事项	27.90	-	-	456,226	9,435,928.04	12,728,705.40	-
600167	联美控股	2015 年 5 月 27 日	重大 事项	25.76	-	-	470,655	9,304,455.54	12,124,072.80	-
002545	东方铁塔	2015 年 5 月 19 日	重大 事项	26.79	-	-	423,544	9,508,734.33	11,346,743.76	-
300071	华谊嘉信	2015 年 5 月 21 日	重大 事项	13.66	-	-	778,140	9,237,504.79	10,629,392.40	-
002416	爱施德	2015 年 5 月 5 日	重大 事项	20.67	2015 年 7 月 29 日	18.60	481,700	9,455,832.84	9,956,739.00	-
002643	万润股份	2015 年 5 月 4 日	重大 事项	28.70	-	-	337,379	9,492,350.46	9,682,777.30	-
002662	京威股份	2015 年 5 月 15 日	重大 事项	17.84	2015 年 8 月 13 日	16.06	492,100	9,168,090.78	8,779,064.00	-
002027	七喜控股	2015 年 5 月 4 日	重大 事项	14.88	-	-	679,400	8,653,395.20	10,109,472.00	-
002194	武汉凡谷	2015 年 6 月 18 日	重大 事项	21.08	2015 年 7 月 24 日	24.28	6,684,251	134,463,358.27	140,904,011.08	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,500,599,573.35	80.32
	其中：股票	9,500,599,573.35	80.32
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	1,447,928,206.36	12.24
7	其他各项资产	879,921,491.15	7.44
8	合计	11,828,449,270.86	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	102,092,691.44	0.99
C	制造业	5,187,120,834.42	50.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	513,693,263.27	5.00
E	建筑业	125,353,869.23	1.22
F	批发和零售业	210,315,687.81	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	176,795,460.30	1.72
H	住宿和餐饮业	43,631,163.40	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务	268,388,520.00	2.61

	业		
J	金融业	1,939,711,281.60	18.88
K	房地产业	70,195,373.21	0.68
L	租赁和商务服务业	204,039,786.42	1.99
M	科学研究和技术服务业	64,883,498.40	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	13,032,442.08	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	50,252,140.72	0.49
R	文化、体育和娱乐业	531,093,561.05	5.17
S	综合	-	-
	合计	9,500,599,573.35	92.45

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601111	中国国航	9,218,425	141,595,008.00	1.38
2	002194	武汉凡谷	6,684,251	140,904,011.08	1.37
3	002706	良信电器	2,135,349	139,224,754.80	1.35
4	002546	新联电子	4,004,876	132,801,688.16	1.29
5	002498	汉缆股份	5,976,407	122,934,691.99	1.20

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.nffund.com> 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300243	瑞丰高材	181,461,711.15	1.77
2	002533	金杯电工	175,428,888.11	1.71
3	300160	秀强股份	174,862,753.50	1.70
4	300136	信维通信	170,042,205.04	1.65
5	300011	鼎汉技术	168,632,013.58	1.64

6	300115	长盈精密	165,331,469.42	1.61
7	300114	中航电测	163,864,863.08	1.59
8	600079	人福医药	163,387,444.52	1.59
9	600529	山东药玻	163,236,389.02	1.59
10	002121	科陆电子	163,000,363.94	1.59
11	002179	中航光电	161,532,640.82	1.57
12	600369	西南证券	160,561,847.29	1.56
13	000090	天健集团	160,449,826.12	1.56
14	002433	太安堂	159,576,049.05	1.55
15	002498	汉缆股份	159,230,378.49	1.55
16	002399	海普瑞	158,351,797.93	1.54
17	600551	时代出版	158,238,398.83	1.54
18	000623	吉林敖东	158,163,664.48	1.54
19	300333	兆日科技	157,947,959.84	1.54
20	002281	光迅科技	157,491,056.96	1.53

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000039	中集集团	169,897,275.39	1.65
2	300199	翰宇药业	146,527,343.37	1.43
3	002533	金杯电工	138,157,322.45	1.34
4	000725	京东方 A	127,549,155.55	1.24
5	300136	信维通信	113,534,878.14	1.10
6	600298	安琪酵母	113,467,719.59	1.10
7	600475	华光股份	110,092,924.83	1.07
8	002089	新海宜	108,403,258.77	1.05
9	002202	金风科技	108,076,812.77	1.05
10	300219	鸿利光电	104,278,547.29	1.01
11	002560	通达股份	103,368,852.09	1.01
12	000063	中兴通讯	102,765,568.53	1.00
13	002623	亚玛顿	101,658,309.70	0.99
14	002111	威海广泰	99,798,037.60	0.97

15	600004	白云机场	99,410,329.97	0.97
16	000501	鄂武商 A	98,927,910.85	0.96
17	002261	拓维信息	96,335,248.31	0.94
18	002300	太阳电缆	95,137,209.73	0.93
19	002430	杭氧股份	95,028,747.50	0.92
20	000756	新华制药	94,438,103.27	0.92

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	19,548,804,439.54
卖出股票收入（成交）总额	8,031,570,780.18

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。

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1507	IF1507	20	26,260,800.00	1,610,960.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,610,960.00
股指期货投资本期收益（元）					-144,810,600.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,610,960.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证，运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。

基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**7.12.2** 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	2,865,219.26
2	应收证券清算款	854,428,820.01
3	应收股利	-
4	应收利息	217,554.13
5	应收申购款	22,409,897.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	879,921,491.15

7.12.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.4.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.4.2 期末积极投资前五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	601111	中国国航	141,595,008.00	1.38	重大事项
2	002706	良信电器	139,224,754.80	1.35	重大事项
3	002546	新联电子	132,801,688.16	1.29	重大事项
4	002498	汉缆股份	122,934,691.99	1.20	重大事项

7.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
248,738	10,135,681,826.60	79,181,455.20	0.78%	10,056,500,371.40	99.22%

8.2 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	2,489,620.80	0.0240%

8.3 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月24日）基金份额总额	991,441,210.52
本报告期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	11,111,290,519.01
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,967,049,902.93
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	10,135,681,826.60

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	280,949,652.91	1.02%	255,775.34	7.31%	-
华泰证券	2	9,988,958,164.29	36.22%	1,512,792.58	43.23%	-
申银万国	2	13,487,702,364.18	48.90%	1,348,818.95	38.54%	-
银河证券	2	3,821,987,975.65	13.86%	382,214.89	10.92%	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

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

B：选择流程

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

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