

南方高端装备灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年半年度报告

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 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§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.....	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 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.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
7.7 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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46

§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 备查文件目录	52
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	南方高端装备灵活配置混合
基金主代码	202027
前端交易代码	202027
后端交易代码	202028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 7 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	524,955,295.34 份
基金合同存续期	不定期

注：1. 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“南方高端装备”。

2. 本基金转型日期为 2014 年 7 月 24 日，该日起原南方金粮油股票型证券投资基金正式变更为南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资高端装备证券，在严格控制风险的前提下追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：</p> <p>(1) 宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等；</p> <p>(2) 微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等；</p> <p>(3) 市场指标，包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等；</p> <p>(4) 政策因素，包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。</p> <p>本基金根据上述研究，分析市场风险相对变化趋势，及时确定基金资产在股票、债券以及货币市场工具等类别资产间的分配比例，有效管理市场风险，提高基金收益率。</p>
业绩比较基准	中证装备产业指数×80% + 上证国债指数×20%
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率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	鲍文革	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
注册地址		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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		吴万善	姜建清

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 6 号免税商务大厦塔楼 31-33 层

§ 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 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	411,006,141.01
本期利润	362,962,944.88
加权平均基金份额本期利润	0.5744
本期加权平均净值利润率	37.10%
本期基金份额净值增长率	47.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	245,260,859.04
期末可供分配基金份额利润	0.4672
期末基金资产净值	796,982,634.43

期末基金份额净值	1.518
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	90.38%

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。

4. 本基金转型日期为2014年7月24日, 截止报告期末, 本基金转型后基金合同生效未满一年。

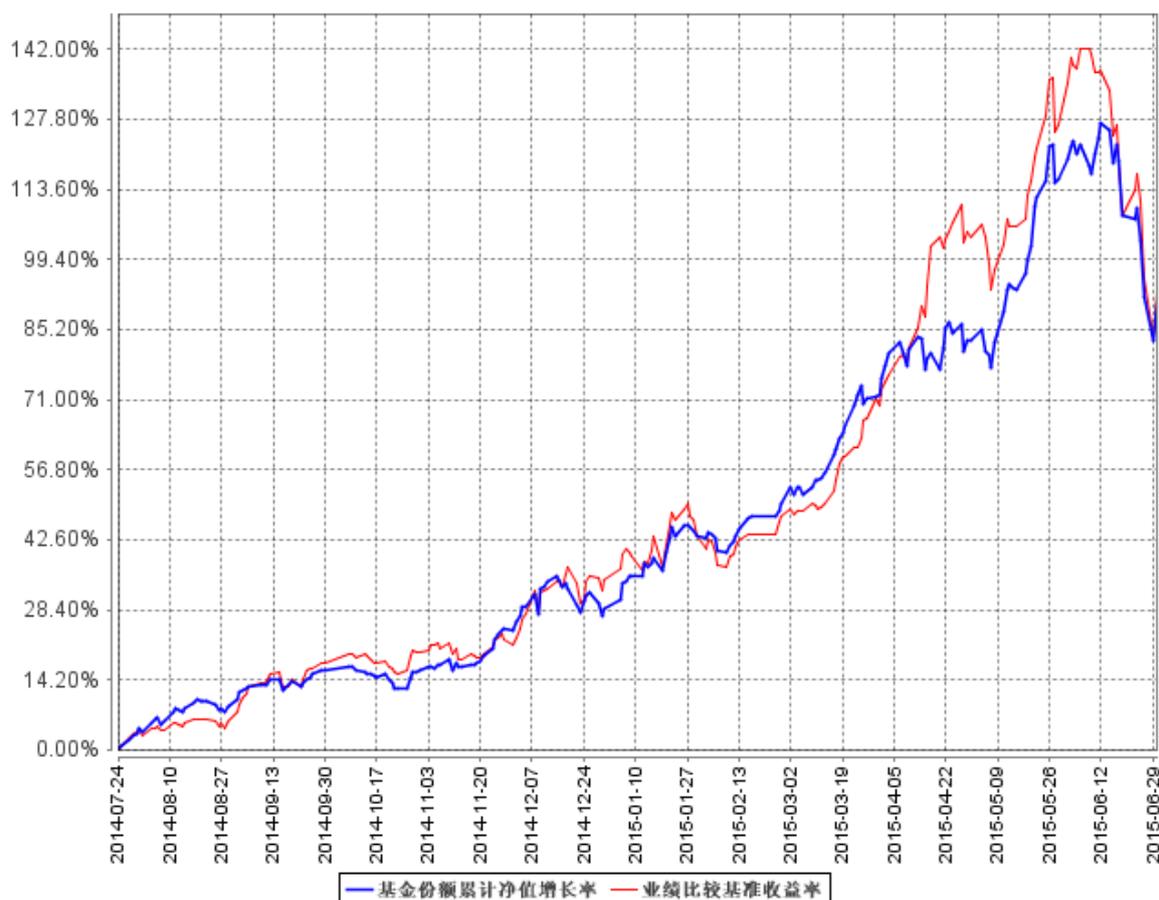
3.2 基金净值表现

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	-11.69%	2.55%	-14.89%	3.16%	3.20%	-0.61%
过去三个月	10.76%	2.14%	13.74%	2.47%	-2.98%	-0.33%
过去六个月	47.86%	1.71%	43.27%	2.03%	4.59%	-0.32%
自基金转型起至今	90.38%	1.41%	92.89%	1.67%	-2.51%	-0.26%

3.2.2 自基金转型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：1、本基金转型日期为 2014 年 7 月 24 日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。
- 2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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		
杜冬松	本基金基金经理	2014 年 7 月 24 日	-	13 年	第三军医大学医学硕士，具有基金从业资格。曾担任天津 272 医院外科主治医师、深圳健安医药市场部部长、中新药业成药分公司学术推广部部长；2002 年 4 月至 2008 年 8 月，历任平安证券研究所研究员、医药行业首席研究员、行业部副总经理。2008 年 9 月加入南方基金，任研究部医药行业首席研究员和消费组组长；2012 年 3 月至 2015 年 4 月，任南方消费基金经理；2013 年 7 月至今，任南方高端装备（原金粮油）基金经理；2014 年 1 月至今，任南方医保基金经理；2015 年 3 月至今，任南方创新经济的基金经理。
骆帅	本基金基金经理	2015 年 5 月 28 日	-	6 年	清华大学管理科学与工程专业硕士，具有基金从业资格，2009 年 7 月加入南方基金，担任研究部研究员、高级研究员；2014 年 3 月至 2015 年 5 月，任南方成份、南方安心基金经理助理；2015 年 5 月至今，任南方高端装备基金经理；2015 年 6 月至今，任南方价值、南方成长基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方高端装备灵活配置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

2015 年上半年，宏观经济呈现震荡寻底的局面，房地产销售明显转好，但并未向上游投资有效传导，汽车等耐用消费品较为疲弱，总体而言实体经济缺乏亮点。市场在上半年大部分时间里维持了上涨格局，以中小板、创业板为首，不断创出新高，但从 6 月中旬开始出现了快速下跌，力度之猛烈达到了罕见的程度。在前所未有的融资杠杆下，上涨和下跌都更加剧烈，容易引起自反馈循环。

报告期内，本基金较好地把握住了高端装备产业的投资机会，以工业 4.0 为主线，对制造业中能够不断产业升级的企业进行了重点配置。随着中国本土企业在高端、精密制造方面不断进步，在国内、国际市场上竞争力不断增强，相信我们能够充分分享这其中的投资机会。基金仓位方面，充分发挥灵活配置的特点，进入 6 月以后保持了较低的仓位，相对基准下跌较少。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年，本基金净值增长 47.86%，同期业绩比较基准增长 43.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年下半年，宏观经济大概率将企稳，政府可能更多地转向宽松的财政政策，加大支出力度。市场方面，指数将在更小的区间内震荡，同时个股大幅度分化，有业绩持续增长支撑的股票将率先企稳回升，而估值泡沫化的股票将继续“挤泡沫”。转型牛、改革牛并未结束，在注册制即将推行的背景下，优质的公司将真正脱颖而出。

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

本基金由南方金粮油于 2014 年 7 月 24 日正式转型而来。

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，投资者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；若投资者不选择，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，本基金于 2015 年 4 月 16 日进行了收益分配（每 10 份基金份额派发红利 2.3 元）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 243,065,758.08 元。

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

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	331,793,117.67	40,736,627.20
结算备付金		3,298,090.75	204,808.71
存出保证金		938,199.65	71,275.00
交易性金融资产	6.4.3.2	608,033,549.79	113,743,017.89
其中：股票投资		608,033,549.79	113,743,017.89
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	70,993.93	7,620.73
应收股利		-	-
应收申购款		1,949,737.00	1,406,155.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		946,083,688.79	156,169,505.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		77,502,380.92	-
应付赎回款		61,806,119.53	1,504,221.65
应付管理人报酬		1,379,888.23	179,369.80
应付托管费		229,981.37	29,894.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	7,738,082.04	159,941.64
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	444,602.27	292,958.94
负债合计		149,101,054.36	2,166,387.01
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	524,955,295.34	128,966,547.06
未分配利润	6.4.3.10	272,027,339.09	25,036,571.23
所有者权益合计		796,982,634.43	154,003,118.29
负债和所有者权益总计		946,083,688.79	156,169,505.30

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.518 元，基金份额总额 524,955,295.34 份。

6.2 利润表

会计主体：南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		384,446,218.96

1.利息收入		1,361,463.58
其中：存款利息收入	6.4.3.11	975,800.19
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		385,663.39
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		427,305,173.63
其中：股票投资收益	6.4.3.12	424,372,974.36
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.3.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.3.14	-
股利收益	6.4.3.15	2,932,199.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-48,043,196.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	3,822,777.88
减：二、费用		21,483,274.08
1. 管理人报酬		7,132,034.46
2. 托管费		1,188,672.50
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.3.18	12,979,015.84
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.3.19	183,551.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		362,962,944.88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		362,962,944.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1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）	128,966,547.06	25,036,571.23	154,003,118.29
二、本期经营活动产生的基	-	362,962,944.88	362,962,944.88

金净值变动数（本期利润）			
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）	395,988,748.28	127,093,581.06	523,082,329.34
其中：1.基金申购款	2,362,090,134.52	1,229,598,978.99	3,591,689,113.51
2.基金赎回款	-1,966,101,386.24	-1,102,505,397.93	-3,068,606,784.17
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）	-	-243,065,758.08	-243,065,758.08
五、期末所有者权益（基金净值）	524,955,295.34	272,027,339.09	796,982,634.43

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中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。

6.4.1.3 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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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，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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	331,793,117.67
定期存款	-
其他存款	-
合计：	331,793,117.67

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	650,692,974.96	608,033,549.79	-42,659,425.17
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	650,692,974.96	608,033,549.79	-42,659,425.17
----	----------------	----------------	----------------

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	69,278.17
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	1,335.78
应收债券利息	-
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	379.98
合计	70,993.93

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,738,082.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,738,082.04

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	266,081.97
预提费用	178,520.30
合计	444,602.27

6.4.3.9 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6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,966,547.06	128,966,547.06
本期申购	2,362,090,134.52	2,362,090,134.52
本期赎回(以“-”号填列)	-1,966,101,386.24	-1,966,101,386.24
本期末	524,955,295.34	524,955,295.34

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 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	14,882,957.77	10,153,613.46	25,036,571.23
本期利润	411,006,141.01	-48,043,196.13	362,962,944.88
本期基金份额交易产生的变动数	62,437,518.34	64,656,062.72	127,093,581.06
其中：基金申购款	562,664,467.50	666,934,511.49	1,229,598,978.99
基金赎回款	-500,226,949.16	-602,278,448.77	-1,102,505,397.93
本期已分配利润	-243,065,758.08	-	-243,065,758.08
本期末	245,260,859.04	26,766,480.05	272,027,339.09

6.4.3.11 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6月30日
	活期存款利息收入
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	58,871.81
其他	3,132.59
合计	975,800.19

6.4.3.12 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6月30日
卖出股票成交总额	4,270,553,721.88
减：卖出股票成本总额	3,846,180,747.52
买卖股票差价收入	424,372,974.36

6.4.3.13 债券投资收益

无。

6.4.3.14 衍生工具收益

无。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,932,199.27
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,932,199.27

6.4.3.16 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6月30日
1. 交易性金融资产	-48,043,196.13
——股票投资	-48,043,196.13
——债券投资	-
——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	-48,043,196.13

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,672,851.87
转换费	149,926.01
合计	3,822,777.88

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。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	12,979,015.84
银行间市场交易费用	-
合计	12,979,015.84

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,767.52
其他	200.00
银行汇划费	330.98
账户维护费	4,500.00
合计	183,551.28

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

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

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。

6.4.6 本报告期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 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6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	2,080,481,940.79	24.03%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 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	1,841,021.16	23.79%	1,841,021.16	23.79%

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,132,034.46
其中：支付销售机构的客户维护费	2,913,369.34

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,188,672.50

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.5 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 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	331,793,117.67	913,795.79

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2015 年 4 月 16 日	2015 年 4 月 16 日	2.3000	152,123,498.58	90,942,259.50	243,065,758.08	
合计	-	-	2.3000	152,123,498.58	90,942,259.50	243,065,758.08	

6.4.8 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 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
000008	神州高铁	2015 年 3 月 12 日	重大事项停牌	31.45	2015 年 7 月 2 日	29.56	271,730.00	6,275,184.00	8,545,908.50	-
000558	莱茵置业	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	26.11	2015 年 7 月 13 日	29.52	281,900.00	9,129,978.00	7,360,409.00	-
002303	美盈森	2015 年 6 月 9 日	重大事项停牌	47.7	2015 年 7 月 13 日	21.43	53.00	1,338.39	2,528.10	-
002388	新亚制程	2015 年 5 月 20 日	重大事项停牌	26.74	2015 年 8 月 20 日	12.87	8.00	176.58	213.92	-
002527	新时达	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	24.25	-	-	379,650.00	11,656,105.00	9,206,512.50	-
002662	京威股份	2015 年 5 月 15 日	重大事项停牌	17.84	2015 年 8 月 13 日	16.06	9.00	165.71	160.56	-
002665	首航节能	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	27.7	2015 年 7 月 1 日	30.00	15.00	251.17	415.50	-
300190	维尔利	2015 年 5 月 25 日	非公开发行	34.34	-	-	52.00	675.36	1,785.68	-
300255	常山药业	2015 年 6 月 3 日	重大事项停牌	34.71	2015 年 7 月 13 日	31.24	35.00	478.19	1,214.85	-
300419	浩丰科技	2015 年 4 月 24 日	重大事项停牌	228.45	2015 年 8 月 14 日	216.41	50,800.00	8,869,956.60	11,605,260.00	-
600790	轻纺城	2015 年 5 月 25 日	非公开发行	13.38	2015 年 8 月 18 日	12.04	35.00	386.20	468.30	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理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以上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“风险和收益相匹配”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。

6.4.9.2 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工商银行，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；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，且通过分散化投资以分散信用风险。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。

6.4.9.3 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的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	331,793,117.67	-	-	-	331,793,117.67
结算备付金	3,298,090.75	-	-	-	3,298,090.75
存出保证金	938,199.65	-	-	-	938,199.65
交易性金融资产	-	-	-	608,033,549.79	608,033,549.79
应收利息	-	-	-	70,993.93	70,993.93
应收申购款	526,623.04	-	-	1,423,113.96	1,949,737.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	336,556,031.11	-	-	609,527,657.68	946,083,688.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	77,502,380.92	77,502,380.92
应付赎回款	-	-	-	61,806,119.53	61,806,119.53
应付管理人报酬	-	-	-	1,379,888.23	1,379,888.23
应付托管费	-	-	-	229,981.37	229,981.37
应付交易费用	-	-	-	7,738,082.04	7,738,082.04
其他负债	-	-	-	444,602.27	444,602.27
负债总计	-	-	-	149,101,054.36	149,101,054.36
利率敏感度缺口	336,556,031.11	-	-	460,426,603.32	796,982,634.43
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	40,736,627.20	-	-	-	40,736,627.20
结算备付金	204,808.71	-	-	-	204,808.71
存出保证金	71,275.00	-	-	-	71,275.00

交易性金融资产	-	-	-113,743,017.89	113,743,017.89
应收利息	-	-	7,620.73	7,620.73
应收申购款	10,081.42	-	1,396,074.35	1,406,155.77
资产总计	41,022,792.33	-	-115,146,712.97	156,169,505.30
负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	1,504,221.65	1,504,221.65
应付管理人报酬	-	-	179,369.80	179,369.80
应付托管费	-	-	29,894.98	29,894.98
应付交易费用	-	-	159,941.64	159,941.64
其他负债	-	-	292,958.94	292,958.94
负债总计	-	-	2,166,387.01	2,166,387.01
利率敏感度缺口	41,022,792.33	-	-112,980,325.96	154,003,118.29

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日：同），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：同）。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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。本基金股票投资占基金资产的比例范围 0-95%；债券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具投资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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 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	608,033,549.79	76.29	113,743,017.89	73.86
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	608,033,549.79	76.29	113,743,017.89	73.86

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 6 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 2,242	增加约 275
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 2,242	减少约 275

§ 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	608,033,549.79	64.27
	其中: 股票	608,033,549.79	64.27
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	335,091,208.42	35.42
7	其他各项资产	2,958,930.58	0.31
8	合计	946,083,688.79	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,375,878.00	1.43
B	采矿业	15,758,694.00	1.98
C	制造业	514,880,790.79	64.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,933.25	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,010.97	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,651,051.30	7.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,360,409.00	0.92
L	租赁和商务服务业	468.30	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,528.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,785.68	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	608,033,549.79	76.29

7.3 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	002415	海康威视	964,137	43,193,337.60	5.42

2	000039	中集集团	1,157,300	37,380,790.00	4.69
3	600172	黄河旋风	1,721,400	35,856,762.00	4.50
4	300017	网宿科技	627,115	29,110,678.30	3.65
5	603308	应流股份	893,800	26,134,712.00	3.28
6	300032	金龙机电	716,047	24,574,733.04	3.08
7	600487	亨通光电	630,200	23,191,360.00	2.91
8	300011	鼎汉技术	612,888	21,708,492.96	2.72
9	002073	软控股份	921,600	21,288,960.00	2.67
10	002444	巨星科技	1,051,344	19,428,837.12	2.44
11	300126	锐奇股份	600,700	17,774,713.00	2.23
12	002031	巨轮股份	1,106,600	17,639,204.00	2.21
13	300207	欣旺达	720,385	17,447,724.70	2.19
14	002456	欧菲光	489,400	16,512,356.00	2.07
15	002139	拓邦股份	698,505	16,296,121.65	2.04
16	600583	海油工程	945,900	15,758,694.00	1.98
17	000938	紫光股份	171,900	15,555,231.00	1.95
18	300351	永贵电器	352,500	13,518,375.00	1.70
19	000768	中航飞机	298,800	13,021,704.00	1.63
20	300201	海伦哲	801,700	12,747,030.00	1.60
21	002185	华天科技	704,400	12,693,288.00	1.59
22	601313	江南嘉捷	653,842	12,233,383.82	1.53
23	300130	新国都	315,258	12,140,585.58	1.52
24	300419	浩丰科技	50,800	11,605,260.00	1.46
25	600965	福成五丰	689,441	11,375,776.50	1.43
26	002421	达实智能	560,100	11,218,803.00	1.41
27	002527	新时达	379,650	9,206,512.50	1.16
28	300053	欧比特	190,400	8,872,640.00	1.11
29	002380	科远股份	147,922	8,680,062.96	1.09
30	000008	神州高铁	271,730	8,545,908.50	1.07
31	600894	广日股份	426,901	8,520,943.96	1.07
32	300088	长信科技	306,200	8,420,500.00	1.06
33	002502	骅威股份	376,850	8,399,986.50	1.05
34	601766	中国中车	453,600	8,328,096.00	1.04
35	002112	三变科技	449,229	7,641,385.29	0.96
36	000558	莱茵置业	281,900	7,360,409.00	0.92
37	000948	南天信息	180,500	6,714,600.00	0.84
38	300038	梅泰诺	106,065	4,770,803.70	0.60
39	002611	东方精工	224,283	3,128,747.85	0.39
40	002572	索菲亚	78	3,013.14	0.00

41	002273	水晶光电	96	3,000.00	0.00
42	002303	美盈森	53	2,528.10	0.00
43	600885	宏发股份	77	2,413.18	0.00
44	600118	中国卫星	40	2,278.40	0.00
45	300237	美晨科技	60	1,966.20	0.00
46	600969	郴电国际	95	1,933.25	0.00
47	002508	老板电器	48	1,841.28	0.00
48	300190	维尔利	52	1,785.68	0.00
49	300183	东软载波	60	1,710.00	0.00
50	002481	双塔食品	40	1,665.20	0.00
51	002149	西部材料	58	1,650.68	0.00
52	300284	苏文科	75	1,528.50	0.00
53	300255	常山药业	35	1,214.85	0.00
54	002100	天康生物	94	1,100.74	0.00
55	300139	福星晓程	50	1,015.00	0.00
56	000759	中百集团	79	945.63	0.00
57	300210	森远股份	44	858.00	0.00
58	600686	金龙汽车	24	617.76	0.00
59	600790	轻纺城	35	468.30	0.00
60	002665	首航节能	15	415.50	0.00
61	002318	久立特材	6	314.28	0.00
62	002297	博云新材	14	254.10	0.00
63	002388	新亚制程	8	213.92	0.00
64	600295	鄂尔多斯	16	192.00	0.00
65	002540	亚太科技	13	188.50	0.00
66	600469	风神股份	10	180.80	0.00
67	600500	中化国际	10	174.80	0.00
68	002158	汉钟精机	7	168.00	0.00
69	002662	京威股份	9	160.56	0.00
70	002299	圣农发展	5	101.50	0.00
71	002520	日发精机	2	65.60	0.00
72	600058	五矿发展	2	65.34	0.00
73	000541	佛山照明	1	11.47	0.00

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	002415	海康威视	77,544,950.41	50.35
2	000039	中集集团	76,654,137.29	49.77
3	000625	长安汽车	66,560,722.07	43.22
4	002241	歌尔声学	66,516,998.10	43.19
5	600332	白云山	62,913,202.67	40.85
6	600761	安徽合力	60,019,295.30	38.97
7	300274	阳光电源	52,340,629.64	33.99
8	300011	鼎汉技术	51,620,448.83	33.52
9	000157	中联重科	47,994,260.69	31.16
10	002472	双环传动	45,358,292.24	29.45
11	002642	荣之联	45,303,033.90	29.42
12	002363	隆基机械	44,234,162.17	28.72
13	600458	时代新材	43,439,469.04	28.21
14	002540	亚太科技	42,516,038.16	27.61
15	300115	长盈精密	42,217,656.92	27.41
16	002284	亚太股份	41,903,435.64	27.21
17	002256	彩虹精化	40,345,799.50	26.20
18	000523	广州浪奇	39,649,749.48	25.75
19	600172	黄河旋风	39,590,627.76	25.71
20	002235	安妮股份	39,582,444.46	25.70
21	300180	华峰超纤	39,430,866.00	25.60
22	600350	山东高速	36,800,438.57	23.90
23	002662	京威股份	36,033,154.52	23.40
24	600582	天地科技	35,175,127.20	22.84
25	000690	宝新能源	34,811,833.20	22.60
26	600835	上海机电	34,262,226.67	22.25
27	300222	科大智能	32,738,670.50	21.26
28	601169	北京银行	32,399,246.79	21.04
29	601989	中国重工	31,936,629.85	20.74
30	002444	巨星科技	31,895,687.50	20.71
31	600728	佳都科技	28,529,673.39	18.53
32	000887	中鼎股份	27,924,746.82	18.13
33	002303	美盈森	27,261,526.52	17.70
34	603308	应流股份	27,218,060.33	17.67
35	300017	网宿科技	27,134,589.09	17.62

36	600382	广东明珠	26,617,164.66	17.28
37	002481	双塔食品	26,578,726.54	17.26
38	000530	大冷股份	26,537,773.09	17.23
39	600165	新日恒力	26,431,411.76	17.16
40	002034	美欣达	26,417,628.39	17.15
41	600289	亿阳信通	26,405,252.62	17.15
42	300154	瑞凌股份	26,395,375.32	17.14
43	002098	浔兴股份	26,363,263.79	17.12
44	002250	联化科技	26,310,723.37	17.08
45	600486	扬农化工	26,298,668.84	17.08
46	000768	中航飞机	26,279,021.27	17.06
47	600487	亨通光电	25,945,290.10	16.85
48	000821	京山轻机	25,804,550.63	16.76
49	600169	太原重工	25,755,620.44	16.72
50	601718	际华集团	25,710,861.79	16.70
51	000800	一汽轿车	25,520,713.58	16.57
52	603699	纽威股份	25,408,505.40	16.50
53	600089	特变电工	25,315,297.03	16.44
54	002701	奥瑞金	25,257,896.45	16.40
55	601600	中国铝业	25,149,622.01	16.33
56	300109	新开源	25,011,753.59	16.24
57	000829	天音控股	24,983,922.75	16.22
58	002158	汉钟精机	24,239,964.55	15.74
59	000410	沈阳机床	23,853,232.78	15.49
60	300072	三聚环保	23,705,776.98	15.39
61	002273	水晶光电	23,673,475.73	15.37
62	002206	海利得	23,595,156.86	15.32
63	600655	豫园商城	23,342,873.58	15.16
64	300032	金龙机电	22,772,168.72	14.79
65	002031	巨轮股份	22,694,361.84	14.74
66	002650	加加食品	22,655,369.38	14.71
67	600523	贵航股份	22,625,711.02	14.69
68	300126	锐奇股份	22,499,352.00	14.61
69	601636	旗滨集团	22,199,089.81	14.41
70	601166	兴业银行	21,623,201.00	14.04
71	600000	浦发银行	21,601,350.90	14.03

72	000651	格力电器	21,421,456.48	13.91
73	600790	轻纺城	21,122,742.04	13.72
74	300198	纳川股份	21,027,962.50	13.65
75	600252	中恒集团	20,972,402.91	13.62
76	002050	三花股份	20,101,395.98	13.05
77	002073	软控股份	19,953,699.47	12.96
78	600469	风神股份	19,781,524.00	12.84
79	000750	国海证券	19,689,960.00	12.79
80	002022	科华生物	19,689,955.54	12.79
81	002467	二六三	19,227,714.16	12.49
82	002388	新亚制程	19,218,279.06	12.48
83	300351	永贵电器	19,150,644.90	12.44
84	600525	长园集团	18,620,008.24	12.09
85	002456	欧菲光	18,615,868.51	12.09
86	002739	万达院线	17,746,332.10	11.52
87	002297	博云新材	17,703,727.82	11.50
88	002321	华英农业	17,607,887.99	11.43
89	300201	海伦哲	17,440,379.12	11.32
90	600177	雅戈尔	17,209,604.00	11.17
91	601000	唐山港	17,114,084.96	11.11
92	300210	森远股份	17,024,812.17	11.05
93	300183	东软载波	16,970,985.00	11.02
94	002380	科远股份	16,936,280.05	11.00
95	300290	荣科科技	16,897,142.00	10.97
96	300430	诚益通	16,883,149.87	10.96
97	600266	北京城建	16,842,955.00	10.94
98	000528	柳工	16,815,430.25	10.92
99	600372	中航电子	16,728,905.06	10.86
100	002402	和而泰	16,673,300.34	10.83
101	600827	百联股份	16,552,380.92	10.75
102	601021	春秋航空	16,321,081.60	10.60
103	002441	众业达	16,293,617.00	10.58
104	002318	久立特材	16,254,682.32	10.55
105	600176	中国巨石	16,243,506.60	10.55
106	002322	理工监测	16,237,680.04	10.54
107	300284	苏交科	16,223,193.62	10.53

108	600583	海油工程	16,142,312.50	10.48
109	002572	索菲亚	16,029,070.26	10.41
110	000778	新兴铸管	15,935,932.61	10.35
111	600818	中路股份	15,851,981.48	10.29
112	000785	武汉中商	15,768,388.52	10.24
113	600074	保千里	15,665,533.68	10.17
114	300207	欣旺达	15,646,759.79	10.16
115	002086	东方海洋	15,236,572.11	9.89
116	000938	紫光股份	15,158,190.00	9.84
117	000049	德赛电池	14,971,512.95	9.72
118	600366	宁波韵升	14,916,176.17	9.69
119	300403	地尔汉宇	14,839,231.68	9.64
120	300416	苏试试验	14,798,426.33	9.61
121	002139	拓邦股份	14,722,231.24	9.56
122	002142	宁波银行	14,489,919.10	9.41
123	603899	晨光文具	14,415,136.61	9.36
124	002055	得润电子	14,361,225.14	9.33
125	002421	达实智能	14,205,661.54	9.22
126	300175	朗源股份	14,032,926.57	9.11
127	002312	三泰控股	14,012,529.19	9.10
128	600894	广日股份	13,992,708.04	9.09
129	000488	晨鸣纸业	13,803,436.54	8.96
130	600459	贵研铂业	13,512,575.20	8.77
131	000561	烽火电子	13,480,011.27	8.75
132	600058	五矿发展	13,461,976.69	8.74
133	002375	亚厦股份	13,461,247.77	8.74
134	000006	深振业 A	13,195,165.76	8.57
135	600481	双良节能	13,062,010.83	8.48
136	600118	中国卫星	12,988,566.30	8.43
137	300057	万顺股份	12,986,360.75	8.43
138	600965	福成五丰	12,951,646.94	8.41
139	002494	华斯股份	12,799,050.60	8.31
140	000069	华侨城 A	12,766,643.68	8.29
141	000975	银泰资源	12,689,543.13	8.24
142	000543	皖能电力	12,542,474.00	8.14
143	000759	中百集团	12,454,638.35	8.09

144	601313	江南嘉捷	11,995,635.79	7.79
145	002202	金风科技	11,969,405.89	7.77
146	002185	华天科技	11,935,678.90	7.75
147	002527	新时达	11,656,105.00	7.57
148	002714	牧原股份	11,565,300.13	7.51
149	600030	中信证券	11,498,093.00	7.47
150	600439	瑞贝卡	11,486,234.88	7.46
151	600031	三一重工	11,452,465.89	7.44
152	002699	美盛文化	11,397,849.28	7.40
153	300130	新国都	11,340,447.34	7.36
154	600737	中粮屯河	11,313,341.00	7.35
155	600590	泰豪科技	11,249,320.82	7.30
156	000680	山推股份	11,213,483.12	7.28
157	600210	紫江企业	10,971,716.00	7.12
158	002334	英威腾	10,910,671.00	7.08
159	600500	中化国际	10,663,501.01	6.92
160	002100	天康生物	10,579,352.02	6.87
161	600495	晋西车轴	10,493,764.26	6.81
162	002149	西部材料	10,487,782.87	6.81
163	300088	长信科技	10,334,507.00	6.71
164	300053	欧比特	10,301,673.26	6.69
165	000948	南天信息	10,256,476.01	6.66
166	002502	骅威股份	10,224,006.22	6.64
167	300178	腾邦国际	10,034,815.00	6.52
168	600150	中国船舶	10,033,020.00	6.51
169	300066	三川股份	10,025,777.92	6.51
170	600312	平高电气	9,975,061.67	6.48
171	600967	北方创业	9,966,173.48	6.47
172	002508	老板电器	9,958,265.01	6.47
173	601222	林洋电子	9,869,376.48	6.41
174	002299	圣农发展	9,610,269.45	6.24
175	002521	齐峰新材	9,606,936.00	6.24
176	000425	徐工机械	9,465,607.33	6.15
177	601766	中国中车	9,456,527.10	6.14
178	600686	金龙汽车	9,353,420.07	6.07
179	000558	莱茵置业	9,129,978.00	5.93

180	002395	双象股份	9,050,773.00	5.88
181	002649	博彦科技	8,960,506.50	5.82
182	300419	浩丰科技	8,869,956.60	5.76
183	600269	赣粤高速	8,744,043.72	5.68
184	002298	鑫龙电器	8,630,527.00	5.60
185	601006	大秦铁路	8,453,298.91	5.49
186	002112	三变科技	8,354,600.24	5.42
187	000828	东莞控股	8,122,931.49	5.27
188	600033	福建高速	8,100,852.50	5.26
189	600388	龙净环保	8,084,544.00	5.25
190	600499	科达洁能	8,070,815.93	5.24
191	002400	省广股份	7,990,678.14	5.19
192	000031	中粮地产	7,990,354.40	5.19
193	601998	中信银行	7,974,133.65	5.18
194	600048	保利地产	7,964,730.00	5.17
195	300237	美晨科技	7,723,303.29	5.02
196	000801	四川九洲	7,526,176.14	4.89
197	600096	云天化	7,247,373.58	4.71
198	601628	中国人寿	7,074,797.00	4.59
199	300139	福星晓程	7,069,861.04	4.59
200	300058	蓝色光标	7,058,844.60	4.58
201	002215	诺普信	6,987,948.98	4.54
202	600151	航天机电	6,983,868.81	4.53
203	600195	中牧股份	6,983,047.66	4.53
204	601555	东吴证券	6,982,175.00	4.53
205	002090	金智科技	6,845,867.65	4.45
206	601566	九牧王	6,825,100.04	4.43
207	600496	精工钢构	6,707,461.26	4.36
208	600566	济川药业	6,563,844.25	4.26
209	002665	首航节能	6,424,342.85	4.17
210	000008	神州高铁	6,275,184.00	4.07
211	002177	御银股份	6,230,431.48	4.05
212	002367	康力电梯	6,054,186.00	3.93
213	002666	德联集团	5,995,108.78	3.89
214	002366	丹甫股份	5,994,171.50	3.89
215	000826	桑德环境	5,990,184.54	3.89

216	002236	大华股份	5,989,233.46	3.89
217	002609	捷顺科技	5,988,821.54	3.89
218	600406	国电南瑞	5,983,637.90	3.89
219	002573	清新环境	5,781,679.34	3.75
220	600109	国金证券	4,997,947.00	3.25
221	300070	碧水源	4,997,743.00	3.25
222	600887	伊利股份	4,996,896.56	3.24
223	002373	千方科技	4,993,641.86	3.24
224	300382	斯莱克	4,992,785.37	3.24
225	300187	永清环保	4,991,046.60	3.24
226	002583	海能达	4,983,035.33	3.24
227	002354	天神娱乐	4,970,952.00	3.23
228	600498	烽火通信	4,488,614.00	2.91
229	300037	新宙邦	3,993,196.73	2.59
230	300151	昌红科技	3,860,583.50	2.51
231	002383	合众思壮	3,798,238.10	2.47
232	000812	陕西金叶	3,755,413.14	2.44
233	300353	东土科技	3,752,557.00	2.44
234	300007	汉威电子	3,623,351.00	2.35
235	002410	广联达	3,524,925.12	2.29
236	600837	海通证券	3,498,972.00	2.27
237	600270	外运发展	3,496,295.44	2.27
238	002483	润邦股份	3,490,751.48	2.27
239	300303	聚飞光电	3,490,506.97	2.27
240	600376	首开股份	3,487,625.14	2.26

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	000625	长安汽车	67,552,107.96	43.86
2	600332	白云山	63,417,025.55	41.18
3	002241	歌尔声学	61,439,649.18	39.90
4	000690	宝新能源	61,243,450.45	39.77
5	300274	阳光电源	60,995,067.92	39.61

6	600458	时代新材	55,877,408.62	36.28
7	600761	安徽合力	54,396,942.65	35.32
8	002472	双环传动	52,907,726.34	34.35
9	000157	中联重科	52,523,290.01	34.11
10	002540	亚太科技	48,102,238.76	31.23
11	002363	隆基机械	46,834,834.22	30.41
12	601989	中国重工	46,540,042.00	30.22
13	002642	荣之联	45,545,385.73	29.57
14	000887	中鼎股份	45,160,654.01	29.32
15	002415	海康威视	44,976,799.99	29.21
16	002284	亚太股份	42,922,568.39	27.87
17	000523	广州浪奇	39,721,912.14	25.79
18	000039	中集集团	39,224,525.29	25.47
19	002206	海利得	38,769,278.16	25.17
20	600350	山东高速	38,550,323.79	25.03
21	600582	天地科技	38,427,197.20	24.95
22	002256	彩虹精化	37,567,161.93	24.39
23	600728	佳都科技	36,964,640.21	24.00
24	002662	京威股份	35,804,713.31	23.25
25	300115	长盈精密	35,039,604.92	22.75
26	600835	上海机电	34,860,868.13	22.64
27	002235	安妮股份	34,725,306.72	22.55
28	300180	华峰超纤	34,475,871.72	22.39
29	000829	天音控股	34,332,918.95	22.29
30	601718	际华集团	33,450,342.92	21.72
31	300109	新开源	33,187,924.25	21.55
32	300430	诚益通	32,712,113.70	21.24
33	300072	三聚环保	31,918,468.50	20.73
34	601169	北京银行	30,656,232.25	19.91
35	600818	中路股份	30,651,828.33	19.90
36	000530	大冷股份	30,610,421.13	19.88
37	600382	广东明珠	30,518,560.00	19.82
38	300222	科大智能	30,480,080.75	19.79
39	002055	得润电子	28,861,930.03	18.74
40	601600	中国铝业	28,819,432.41	18.71
41	002303	美盈森	28,753,705.95	18.67
42	000800	一汽轿车	28,197,944.47	18.31
43	600089	特变电工	28,131,155.00	18.27

44	002402	和而泰	27,570,639.04	17.90
45	000821	京山轻机	27,509,243.86	17.86
46	002701	奥瑞金	27,233,932.40	17.68
47	002034	美欣达	27,188,386.19	17.65
48	600655	豫园商城	26,673,674.95	17.32
49	000651	格力电器	26,590,829.12	17.27
50	300011	鼎汉技术	26,553,804.76	17.24
51	600165	新日恒力	26,156,414.71	16.98
52	600169	太原重工	25,524,406.60	16.57
53	603699	纽威股份	25,476,109.84	16.54
54	002098	浔兴股份	24,791,967.26	16.10
55	600486	扬农化工	24,470,035.98	15.89
56	002086	东方海洋	24,444,033.51	15.87
57	601166	兴业银行	24,322,445.99	15.79
58	002481	双塔食品	24,239,862.28	15.74
59	002250	联化科技	23,823,289.06	15.47
60	002273	水晶光电	23,714,195.50	15.40
61	600000	浦发银行	23,411,701.85	15.20
62	600289	亿阳信通	23,350,623.39	15.16
63	002158	汉钟精机	23,168,582.16	15.04
64	002321	华英农业	23,060,133.82	14.97
65	601021	春秋航空	22,809,454.57	14.81
66	300198	纳川股份	22,604,644.97	14.68
67	300154	瑞凌股份	22,427,020.23	14.56
68	002650	加加食品	22,110,778.66	14.36
69	600523	贵航股份	22,060,874.02	14.32
70	601636	旗滨集团	21,886,119.04	14.21
71	002739	万达院线	21,580,653.00	14.01
72	600372	中航电子	21,567,677.33	14.00
73	600790	轻纺城	21,220,743.16	13.78
74	300151	昌红科技	21,024,167.25	13.65
75	002050	三花股份	20,897,829.46	13.57
76	000488	晨鸣纸业	20,728,107.87	13.46
77	002022	科华生物	20,722,414.12	13.46
78	002322	理工监测	20,584,173.08	13.37
79	603899	晨光文具	20,037,043.98	13.01
80	002494	华斯股份	20,028,389.12	13.01
81	000750	国海证券	19,659,356.56	12.77

82	000785	武汉中商	19,519,187.25	12.67
83	002297	博云新材	19,156,082.60	12.44
84	000410	沈阳机床	18,937,460.50	12.30
85	600252	中恒集团	18,838,443.38	12.23
86	600469	风神股份	18,798,686.06	12.21
87	600525	长园集团	18,772,980.70	12.19
88	600177	雅戈尔	18,740,268.60	12.17
89	600118	中国卫星	18,267,510.42	11.86
90	600074	保千里	18,074,631.94	11.74
91	002467	二六三	17,890,664.16	11.62
92	002312	三泰控股	17,829,076.41	11.58
93	000543	皖能电力	17,692,840.77	11.49
94	002388	新亚制程	17,495,361.90	11.36
95	600827	百联股份	17,420,441.46	11.31
96	300210	森远股份	17,389,169.25	11.29
97	002699	美盛文化	17,259,409.09	11.21
98	601000	唐山港	16,540,495.15	10.74
99	300403	地尔汉宇	16,538,699.11	10.74
100	000049	德赛电池	16,435,842.06	10.67
101	000778	新兴铸管	16,376,867.34	10.63
102	000528	柳工	16,274,770.28	10.57
103	002142	宁波银行	16,109,595.00	10.46
104	300284	苏交科	15,973,683.23	10.37
105	300139	福星晓程	15,929,195.02	10.34
106	002318	久立特材	15,832,534.63	10.28
107	600266	北京城建	15,647,924.75	10.16
108	600176	中国巨石	15,483,438.43	10.05
109	600388	龙净环保	15,407,401.00	10.00
110	000768	中航飞机	15,212,226.97	9.88
111	002572	索菲亚	15,156,456.92	9.84
112	002665	首航节能	15,093,031.80	9.80
113	002375	亚厦股份	15,004,902.26	9.74
114	300416	苏试试验	14,804,821.68	9.61
115	600366	宁波韵升	14,780,862.28	9.60
116	600481	双良节能	14,626,011.07	9.50
117	600058	五矿发展	14,614,408.27	9.49
118	002441	众业达	14,518,061.70	9.43
119	300290	荣科科技	14,413,303.32	9.36

120	300183	东软载波	14,141,541.42	9.18
121	300057	万顺股份	14,009,919.67	9.10
122	300175	朗源股份	13,734,397.70	8.92
123	601222	林洋电子	13,563,790.84	8.81
124	000069	华侨城 A	13,500,042.30	8.77
125	600459	贵研铂业	13,369,246.56	8.68
126	600967	北方创业	13,361,673.56	8.68
127	002149	西部材料	13,177,052.07	8.56
128	000561	烽火电子	13,072,148.51	8.49
129	300382	斯莱克	12,892,469.64	8.37
130	002202	金风科技	12,476,534.00	8.10
131	000759	中百集团	12,418,838.10	8.06
132	600031	三一重工	12,397,834.86	8.05
133	600495	晋西车轴	11,954,469.72	7.76
134	000975	银泰资源	11,706,226.96	7.60
135	002298	鑫龙电器	11,646,408.88	7.56
136	300070	碧水源	11,352,377.19	7.37
137	002508	老板电器	11,311,348.09	7.34
138	000006	深振业 A	11,270,920.23	7.32
139	000425	徐工机械	11,256,209.35	7.31
140	002100	天康生物	11,211,018.72	7.28
141	600590	泰豪科技	11,184,002.53	7.26
142	600030	中信证券	11,169,045.18	7.25
143	600312	平高电气	11,111,808.92	7.22
144	300237	美晨科技	11,078,810.20	7.19
145	600500	中化国际	10,861,653.00	7.05
146	002215	诺普信	10,803,293.61	7.01
147	600496	精工钢构	10,767,280.00	6.99
148	002714	牧原股份	10,738,967.66	6.97
149	000680	山推股份	10,692,846.09	6.94
150	600737	中粮屯河	10,647,599.40	6.91
151	002573	清新环境	10,571,459.16	6.86
152	002521	齐峰新材	10,496,319.98	6.82
153	600406	国电南瑞	10,476,868.07	6.80
154	300066	三川股份	10,182,876.11	6.61
155	600150	中国船舶	9,972,558.50	6.48
156	600686	金龙汽车	9,940,764.55	6.45
157	000828	东莞控股	9,879,948.78	6.42

158	002610	爱康科技	9,839,504.00	6.39
159	000801	四川九洲	9,733,720.60	6.32
160	600210	紫江企业	9,595,230.81	6.23
161	600439	瑞贝卡	9,583,524.85	6.22
162	601299	中国北车	9,568,496.00	6.21
163	002395	双象股份	9,563,547.67	6.21
164	002334	英威腾	9,459,215.25	6.14
165	002299	圣农发展	9,281,050.19	6.03
166	002609	捷顺科技	9,232,665.95	6.00
167	300178	腾邦国际	9,189,597.65	5.97
168	600269	赣粤高速	9,046,661.14	5.87
169	002649	博彦科技	8,850,970.50	5.75
170	300058	蓝色光标	8,816,892.86	5.73
171	600195	中牧股份	8,806,861.79	5.72
172	002236	大华股份	8,722,785.68	5.66
173	601998	中信银行	8,688,836.93	5.64
174	600151	航天机电	8,655,983.57	5.62
175	000031	中粮地产	8,471,813.03	5.50
176	002444	巨星科技	8,437,008.74	5.48
177	601006	大秦铁路	8,187,405.08	5.32
178	002177	御银股份	8,105,388.09	5.26
179	600499	科达洁能	8,052,503.00	5.23
180	600048	保利地产	8,019,659.46	5.21
181	601555	东吴证券	7,917,470.60	5.14
182	601566	九牧王	7,827,671.00	5.08
183	002666	德联集团	7,771,835.91	5.05
184	300187	永清环保	7,649,031.34	4.97
185	000826	桑德环境	7,583,669.88	4.92
186	002400	省广股份	7,497,127.37	4.87
187	600096	云天化	7,461,238.56	4.84
188	600566	济川药业	7,361,950.33	4.78
189	002111	威海广泰	7,309,898.98	4.75
190	601628	中国人寿	7,278,608.09	4.73
191	002380	科远股份	7,267,692.60	4.72
192	600033	福建高速	7,178,532.00	4.66
193	002583	海能达	7,130,550.00	4.63
194	600894	广日股份	7,095,832.51	4.61
195	002367	康力电梯	6,805,716.94	4.42

196	002366	丹甫股份	6,741,149.00	4.38
197	002179	中航光电	6,430,428.54	4.18
198	002090	金智科技	6,212,120.66	4.03
199	002410	广联达	5,900,143.16	3.83
200	601766	中国中车	5,830,773.00	3.79
201	002373	千方科技	5,753,915.50	3.74
202	300190	维尔利	5,709,344.20	3.71
203	600498	烽火通信	5,647,220.07	3.67
204	300424	航新科技	5,478,000.00	3.56
205	600109	国金证券	5,432,542.31	3.53
206	300303	聚飞光电	5,353,893.00	3.48
207	000812	陕西金叶	5,253,759.77	3.41
208	600887	伊利股份	4,988,269.00	3.24
209	002228	合兴包装	4,885,994.00	3.17
210	002354	天神娱乐	4,816,788.00	3.13
211	300037	新宙邦	4,577,162.40	2.97
212	600969	郴电国际	4,444,574.00	2.89
213	600135	乐凯胶片	4,372,334.00	2.84
214	300353	东土科技	4,323,060.96	2.81
215	600008	首创股份	4,215,120.00	2.74
216	300124	汇川技术	4,150,141.70	2.69
217	002081	金螳螂	4,015,277.51	2.61
218	002383	合众思壮	3,983,195.15	2.59
219	002483	润邦股份	3,960,620.30	2.57
220	600885	宏发股份	3,942,443.00	2.56
221	002268	卫士通	3,764,543.76	2.44
222	600837	海通证券	3,752,332.00	2.44
223	600270	外运发展	3,704,123.21	2.41
224	300007	汉威电子	3,678,244.99	2.39
225	600376	首开股份	3,669,990.23	2.38
226	600690	青岛海尔	3,580,633.31	2.33
227	601677	明泰铝业	3,532,894.00	2.29
228	002292	奥飞动漫	3,516,287.26	2.28
229	000541	佛山照明	3,498,203.44	2.27
230	002151	北斗星通	3,361,478.84	2.18
231	600351	亚宝药业	3,331,729.61	2.16
232	002405	四维图新	3,316,150.00	2.15
233	600184	光电股份	3,309,320.60	2.15

234	600038	中直股份	3,280,140.61	2.13
235	300212	易华录	3,230,792.00	2.10
236	002052	同洲电子	3,197,667.90	2.08
237	300263	隆华节能	3,159,524.67	2.05
238	600271	航天信息	3,119,078.96	2.03

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	4,388,514,475.55
卖出股票收入（成交）总额	4,270,553,721.88

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 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

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

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

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模

型寻求其合理的估值水平，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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

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。

7.12.3 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	938,199.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	70,993.93
5	应收申购款	1,949,737.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,958,930.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
23,486	22,351.84	93,478.43	0.02%	524,861,816.91	99.98%

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	134,405.82	0.0256%

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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型日（2014年7月24日）基金份额总额	43,537,420.45
本报告期期初基金份额总额	128,966,547.06
本报告期基金总申购份额	2,362,090,134.52
减：本报告期基金总赎回份额	1,966,101,386.24
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	524,955,295.34

§ 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	
国泰君安	1	3,598,464,463.81	41.56%	3,184,286.40	41.15%	-
华泰证券	1	2,080,481,940.79	24.03%	1,841,021.16	23.79%	-
中信证券	1	1,602,895,414.87	18.51%	1,459,267.86	18.86%	-
海通证券	1	1,376,875,977.96	15.90%	1,253,506.62	16.20%	-

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

2、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。

10.7.2 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	
	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
国泰君安	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-
中信证券	-	-	380,000,000.00	13.72%
海通证券	-	-	2,390,000,000.00	86.28%

10.8 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6月30日
2	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购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6月30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6月27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 6 月 26 日
5	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
6	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行、手机银行申购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 6 月 1 日
7	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
8	关于南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 29 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 5 月 26 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 5 月 22 日
11	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
12	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
13	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
14	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
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
17	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
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 4 月 15 日
19	南方基金关于旗下部分基金增加晋商银行作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 4 月 15 日
20	南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 14 日
21	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
22	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
23	南方基金关于网上直销汇款交易申购旗下部分基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 2 日
24	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购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 1 日
25	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
26	南方基金关于旗下部分基金增加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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 27 日
27	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 23 日

	务的公告		
28	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
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 3 月 19 日
30	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
31	南方基金关于旗下部分基金增加南海农商银行为代销机构及开通定投、转换业务并参加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 12 日
32	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
33	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
34	南方基金关于旗下部分基金增加中金公司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 2 月 11 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 2、《南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 3、南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告原文。

11.2 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

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>