

# 南方中证国有企业改革指数分级证券投资 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：海通证券股份有限公司

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。

基金托管人海通证券股份有限公司基金托管部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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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.....	13
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.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
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
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
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.....	40
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.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50

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	50
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	50
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
8.12	投资组合报告附注	51
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>52</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2	期末上市基金前十名持有人	52
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	53
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>54</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>54</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	54
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	54
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4	基金投资策略的改变	55
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.8	其他重大事件	56
<b>§12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>62</b>
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	63
12.3	查阅方式	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金		
基金简称	南方中证国有企业改革指数分级		
场内简称	改革基金		
基金主代码	160136		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 3 日		
基金管理人	南方基金管理有限公司		
基金托管人	海通证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	522,407,597.07 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-06-15		
下属分级基金的基金简称	南方中证国有企业改革指数分级	改革 A	改革 B
下属分级基金的场内简称	改革基金	改革 A	改革 B
下属分级基金的交易代码	160136	150295	150296
报告期末下属分级基金份额总额	248,664,095.07 份	136,871,751.00 份	136,871,751.00 份

### 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 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。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	本基金的业绩比较基准：标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

风险收益特征	本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。	改革 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	改革 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。

### 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	海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	朱稼翔
	联系电话	0755-82763888	021-63411463
	电子邮箱	manager@southernfund.com	zhujx@htsec.com
客户服务电话		400-889-8899	021-95553
传真		0755-82763889	021-63410637
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	上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦
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	上海市黄浦区广东路 689 号海通证券大厦
邮政编码		518048	200001
法定代表人		吴万善	王开国

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

	税商务大厦塔楼 31-33 层
--	-----------------

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-665,240,611.87
本期利润	-729,336,856.17
加权平均基金份额本期利润	-0.7495
本期加权平均净值利润率	-74.44%
本期基金份额净值增长率	-29.69%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-341,184,044.24
期末可供分配基金份额利润	-0.6531
期末基金资产净值	549,736,119.64
期末基金份额净值	1.0523
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-29.69%

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、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. 本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

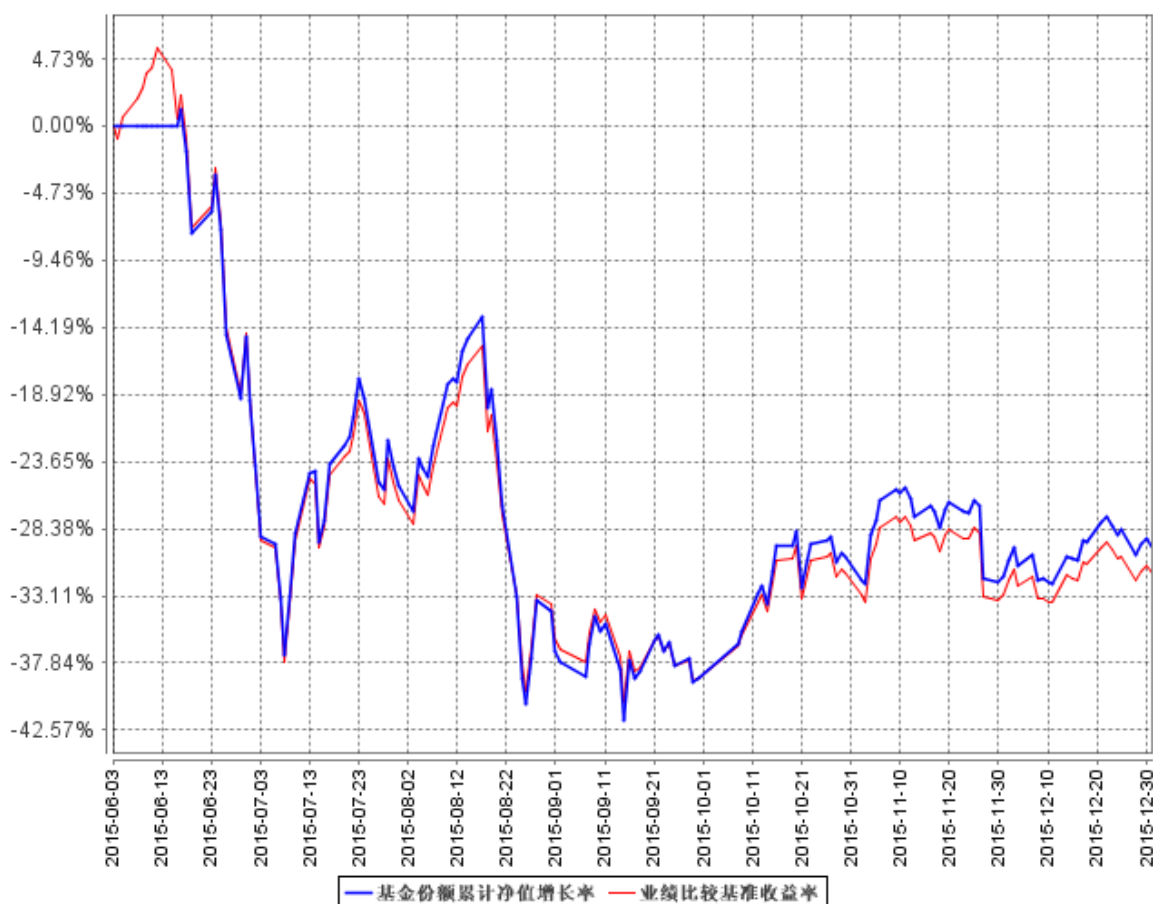
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去三个月	15.12%	2.04%	12.08%	1.87%	3.04%	0.17%
过去六个月	-17.44%	3.31%	-19.84%	3.10%	2.40%	0.21%
自基金合同生效起至今	-29.69%	3.29%	-31.50%	3.14%	1.81%	0.15%

### 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

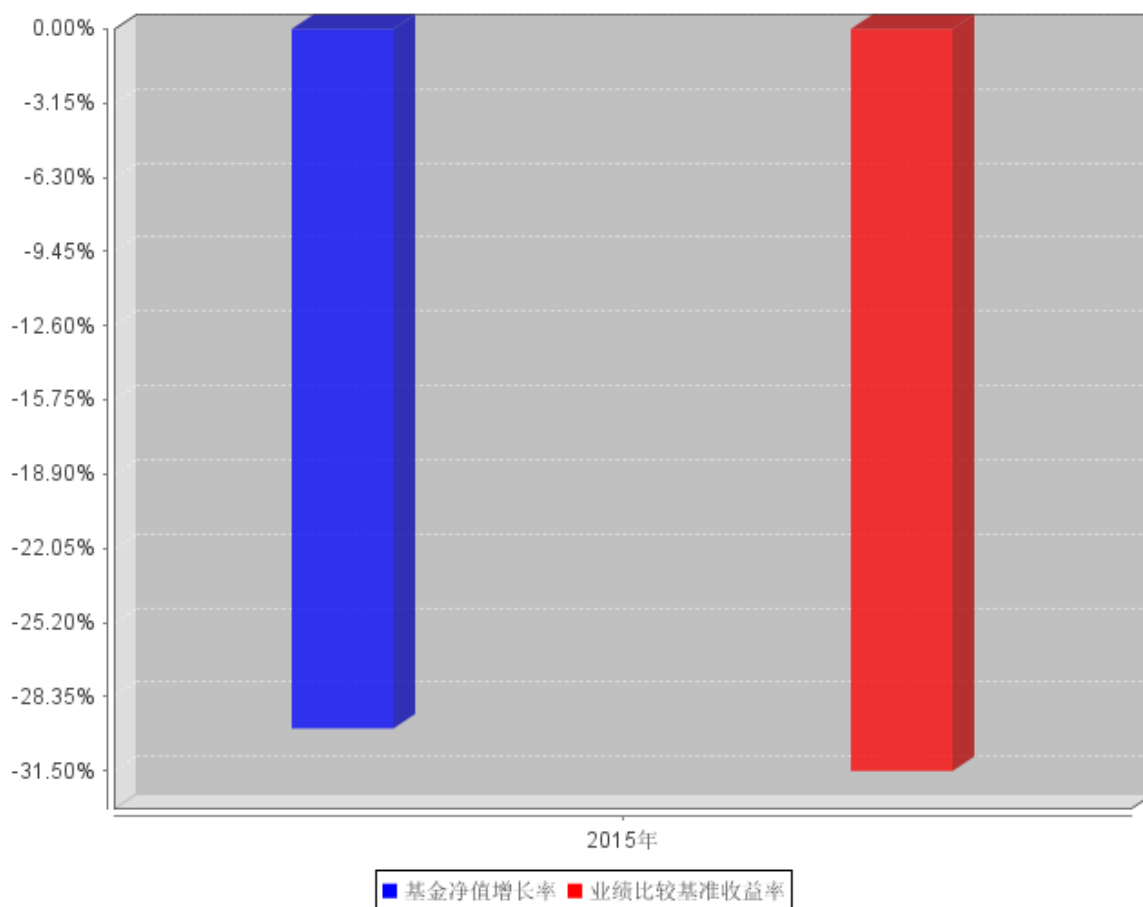


注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金的建仓期为 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 12 月 2 日，报告期末已完成建仓，各项资产配置比例符合合同约定。



### 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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。

目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 5,000 亿元，旗下管理 85 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
雷俊	本基金基金经理	2015 年 6 月 3 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、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。
孙伟	本基金基金经理	2015 年 7 月 2 日	-	6 年	管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、量化投资部量化投资研究员；2014 年 12 月至 2015 年 5 月，担任南方恒生 ETF 的基金经理助理；2015 年 5 月至今，任南方 500 工业 ETF 基金经理；2015 年 5 月至今，任南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月至今，任改革基金、高铁基金、500 信息基金经理。

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《南方中证国有企业改革指数分级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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合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

本基金为指数分级基金，在基础份额之外，还设计了配比为 1:1 的改革 A 和改革 B 两类子份额，并于深交所上市。上市交易的开放式基金都存在两套价格体系，分别是上市价格体系和净值价格体系，两者之间折溢价关系的明确可预期是交易型投资者的基础需求，长期配置型投资者（主要为场外份额投资者）也希望通过投资本基金获取贴近指数的投资回报。所以，我们一直致力于为投资者提供准确、透明的指数化投资工具，不管遭遇市场剧烈波动、大额申赎还是不定期折算，都始终坚守被动投资理念，力争将投资中的主动判断和操作降至最低限度，更不会主动进行大幅增减仓操作。

6 月中下旬，市场出现了历史罕见的快速深幅下探，并且这种走势一直延续到了 7 月初，在调整尾声的 7 月 8 日，本基金触发了向下不定期折算。从临近下折到下折后规模锐减的整个过程中，我们都制定了详细的投资运作方案并加以有效执行，在充分控制流动性风险和市场风险的前提下，尽力将下折对跟踪精度的影响降到最低，并取得了较为理想的效果。

我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- (1) 接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。

### 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 1.0523 元，报告期内，份额净值增长率为-29.69%，同期业绩基准增长率为-31.50%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据“十三五”规划精神和经济转型要求研判，国企改革仍是未来较长时间内 A 股最具价值的投资主题之一。自 2015 年 9 月 13 日《关于深化国有企业改革的指导意见》发布以来，已有 10 余项关于混合所有制、国有资本管理体制的配套文件相继出台，2016 年预计仍会有数量不少于去年的配套文件落地，并有望成为国企改革大年。

2016 年 1 月份，A 股走出了近年来的最差开局，但同时市场风险也得到了较大程度的释放。

展望全年，在利率不断下行和资产配置荒背景下，市场回归牛市的动力仍在，并且随着经济改革转型加速推进，改革红利的释放有望再次提升众多相关受益产业的估值水平。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作，制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所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、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

在存续期内，本基金不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方中证国有企业改革指数分级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，南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金的管理人—南方基金管理有限公司在南方中证国有企业改革指数分级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、不定期份额折算、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，南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 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 21243 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	南方中证国有企业改革指数分级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中证国有企业改革指数分级证券投资基金(以下简称“南方中证国有企业改革基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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	<p>编制和公允列报财务报表是南方中证国有企业改革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：</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>
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，上述南方中证国有企业改革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，公允反映了南方中证国有企业改革基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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：南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	32,325,561.39
结算备付金		719,534.90
存出保证金		5,068,531.69
交易性金融资产	7.4.7.2	540,294,732.29
其中：股票投资		540,294,732.29
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	7,297.19
应收股利		-
应收申购款		32,185.11
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		578,447,842.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-



应付证券清算款		23,549,704.75
应付赎回款		3,645,167.51
应付管理人报酬		487,900.02
应付托管费		97,580.03
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	715,486.82
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	215,883.80
负债合计		28,711,722.93
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	781,881,056.67
未分配利润	7.4.7.10	-232,144,937.03
所有者权益合计		549,736,119.64
负债和所有者权益总计		578,447,842.57

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额总额 522,407,597.07 份，其中南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之基础份额的份额总额为 248,664,095.07 份，基金份额净值 1.0523 元；南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之 A 份额的份额总额为 136,871,751.00 份，基金份额参考净值 1.0276 元；南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之 B 份额的份额总额为 136,871,751.00 份，基金份额参考净值 1.0770 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-717,739,277.18
1.利息收入		1,849,389.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,760,733.18
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		88,656.37
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-659,923,995.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-664,500,008.26

基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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	4,576,012.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-64,096,244.30
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	4,431,572.96
<b>减：二、费用</b>		11,597,578.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,623,297.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,124,659.63
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	4,402,732.44
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	446,888.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-729,336,856.17
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-729,336,856.17

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金

本报告期：2015年6月3日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)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）	868,733,957.36	-	868,733,957.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-729,336,856.17	-729,336,856.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-86,852,900.69	497,191,919.14	410,339,018.45
其中：1. 基金申购款	4,720,485,638.32	-767,407,230.76	3,953,078,407.56

2. 基金赎回款	-4, 807, 338, 539. 01	1, 264, 599, 149. 90	-3, 542, 739, 389. 11
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）	781, 881, 056. 67	-232, 144, 937. 03	549, 736, 119. 64

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

南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金(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]886号《关于准予南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2015]1420号《关于南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》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《南方中证国有企业改革指数分级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基金,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868,670,319.65元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第655号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》于2015年6月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为868,733,957.36份基金份额,其中认购资金利息折合63,637.71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,基金托管人为海通证券股份有限公司。

根据《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“南方国有企业改革份额”)、南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之A份额(以下简称“国有企业改革A份额”)及南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金之B份额(以下简称“国有企业改革B份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售南方国有企业改革份额。投资人场外认购所得的南方国有企业改革份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的南方国有企业改革份额,将按1:1的基金份额配比自动分离为国有企业改革A份额和国有企业改革B份额。国有企业改革A份额和国有企业改革B份额的数量保持1:1的比例不变。基金合同生效后,南方国有企业改革份额

将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内南方国有企业改革份额与国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内南方国有企业改革份额按照 1：1 的份额配比转换成 1 份国有企业改革 A 份额与 1 份国有企业改革 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份国有企业改革 A 份额与 1 份国有企业改革 B 份额按照 1：1 的基金份额配比转换成 2 份场内南方国有企业改革份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：南方国有企业改革份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为南方国有企业改革份额、国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额数量的总和。本基金每份国有企业改革 A 份额与每份国有企业改革 B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份南方国有企业改革份额的基金份额净值之和。国有企业改革 A 份额的约定收益率为一年期银行定期存款利率(税后)+3.5%，国有企业改革 A 份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算，计算出国有企业改革 A 份额的基金份额参考净值后，根据南方国有企业改革份额的基金份额净值与国有企业改革 A 份额、国有企业改革 B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出国有企业改革 B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 1 日(若该日为非工作日，则顺延至下一个工作日；基金合同生效不足 6 个月的除外)，本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后国有企业改革 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算基准日折算前国有企业改革 A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内南方国有企业改革份额分配给国有企业改革 A 份额持有人。南方国有企业改革份额持有人持有的每 2 份南方国有企业改革份额将按 1 份国有企业改革 A 份额获得新增南方国有企业改革份额的分配。持有场外南方国有企业改革份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外南方国有企业改革份额的分配；持有场内南方国有企业改革份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内南方国有企业改革份额的分配。经过上述份额折算后，南方国有企业改革份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。国有企业改革 B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变国有企业改革 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当南方国有企业改革份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当国有企业改革 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将以该日后的

次一交易日为本基金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额的比例为 1:1，份额折算后国有企业改革 A 份额的基金份额参考净值、国有企业改革 B 份额的基金份额参考净值和南方国有企业改革份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当南方国有企业改革份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，基金份额折算基准日折算前南方国有企业改革份额的基金份额净值及国有企业改革 A 份额、国有企业改革 B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为南方国有企业改革份额分别分配给南方国有企业改革份额、国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额的持有人。当国有企业改革 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，南方国有企业改革份额、国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]259 号核准，本基金国有企业改革 A 份额 320,318,311.00 份基金份额与国有企业改革 B 份额 320,318,312.00 份基金份额于 2015 年 6 月 15 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的南方国有企业改革份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的南方国有企业改革份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，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。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外，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、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金 80%以上的基金资产投资于股票，其中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 90%，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：中证国有企业改革指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×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 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》、《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的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 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

### 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。

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

在存续期内，本基金(包括南方国有企业改革份额、国有企业改革 A 份额、国有企业改革 B 份额)不进行收益分配。



#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

### 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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

#### 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	
活期存款	32,325,561.39	
定期存款	-	
其中：存款期限 1-3 个月	-	
其他存款	-	
合计：	32,325,561.39	

### 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	604,390,976.59	540,294,732.29	-64,096,244.30
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	604,390,976.59	540,294,732.29	-64,096,244.30

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末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
应收活期存款利息	4,692.59
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	323.80
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	2,280.80
合计	7,297.19

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	715,486.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	715,486.82

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付赎回费	13,738.04
预提费用	91,000.00
中证指数使用费	111,145.76
合计	215,883.80

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	868,733,957.36	868,733,957.36
本期申购	2,018,259,157.44	2,018,259,157.44
本期赎回(以“-”号填列)	-144,742,150.50	-144,742,150.50
2015 年 7 月 9 日不定期份额折算调整前	2,742,250,964.30	2,742,250,964.30
2015 年 7 月 9 日不定期份额折算调整	-909,980,991.41	-
本期申购	1,805,485,726.64	2,702,226,480.88
本期赎回(以“-”号填列)	-3,115,348,102.46	-4,662,596,388.51
本期末	522,407,597.07	781,881,056.67

注：1. 申购含配对转入份额；赎回含配对转出份额。

2. 本基金自 2015 年 5 月 25 日至 2015 年 5 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 868,670,319.65 元。根据《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 63,637.71 元在本基金成立后，折算为 63,637.71 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 14 日止期间暂不向投资人开放基金交易。配对转换业务及南方国有企业改革份额的申购业务和赎回业务自 2015 年 6 月 15 日起开始办理。

4. 根据《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》和《关于南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》的有关规定，本基金于 2015 年 7 月 9 日进行不定期份额折算。折算前，南方国有企业改革场外和场内份额分别为 223,439,313.30 份和 355,920,410.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.668162775，

折算后南方国有企业改革场外份额总额和场内份额总额分别为 149,293,831.62 份和 237,812,768.00 份，南方国有企业改革份额净值为 1.0000 元；折算前，国有企业改革 A 份额总额为 1,081,445,620.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 1.005828767，折算后国有企业改革 A 份额总额为 357,414,298.00 份，份额净值为 1.0000 元，经份额折算后产生新增的南方国有企业改革场内份额 730,334,816.00 份；折算前，国有企业改革 B 份额总额为 1,081,445,621.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.330496783，折算后国有企业改革 B 份额总额为 357,414,298.00 份，份额净值为 1.0000 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的南方国有企业改革份额、国有企业改革 A 份额和国有企业改革 B 份额进行了折算，并于 2015 年 7 月 10 日进行了变更登记。

5. 截至 2015 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 273,743,502.00 份，其中国有企业改革 A 份额为 136,871,751.00 份，国有企业改革 B 份额为 136,871,751.00 份。托管在深交所场内未上市的基金份额为 122,545,419.00 份，托管在场外未上市的基金份额为 126,118,676.07 份，均为南方国有企业改革份额。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，其中上市的基金份额可选择按市价流通，未上市的基金份额可按基金份额净值申购赎回；场外未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回，通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-665,240,611.87	-64,096,244.30	-729,336,856.17
本期基金份额交易产生的变动数	324,056,567.63	173,135,351.51	497,191,919.14
其中：基金申购款	-518,562,666.63	-248,844,564.13	-767,407,230.76
基金赎回款	842,619,234.26	421,979,915.64	1,264,599,149.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-341,184,044.24	109,039,107.21	-232,144,937.03

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,661,214.73
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	56,091.16
其他	43,427.29
合计	1,760,733.18

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	2,942,935,804.14
减：卖出股票成本总额	3,607,435,812.40
买卖股票差价收入	-664,500,008.26

#### 7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,576,012.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,576,012.87

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-64,096,244.30
——股票投资	-64,096,244.30
——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	-64,096,244.30

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	4,428,445.08
基金合同生效前利息收入	3,127.88
合计	4,431,572.96

注：1. 本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场外赎回费率不高于 0.5%，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 基金合同生效前利息收入是指场内认购部分的认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管户前产生的利息共计人民币 3,127.88 元，计入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	4,402,732.44
银行间市场交易费用	-
合计	4,402,732.44

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	91,000.00
信息披露费	150,000.00
其他	520.00
上市年费	65,000.00
银行费用	11,194.81
中证指数费	129,174.13
合计	446,888.94

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

### 7.4.7.20 分部报告

无。

### 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、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	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（“兴业证券”）	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6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
海通证券	7,154,762,593.13	100.00%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内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6月3日(基金合同生效日)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
海通证券	715,486.82	100.00%	715,486.82	100.00%

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6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,623,297.98
其中：支付销售机构的客户维护费	414,155.11

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 1.00%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 1.00% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,124,659.63

注：支付基金托管人海通证券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

注：本基金本报告期内与关联方未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 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固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

**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**

注：本基金本报告期在基金托管人海通证券无存款余额，同时也无相应存款利息收入。

**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**

注：本基金本报告期内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：本基金本报告期末未持有因认购新发/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
600153	建发股份	2015年6月29日	重大资产重组	14.69	-	-	1,553,000	34,493,783.25	22,813,570.00	-
600729	重庆百货	2015年7月31日	重大资产重组	29.26	2016年1月4日	29.90	150,446	5,457,897.96	4,402,049.96	-
000028	国药一致	2015年10月21日	重大资产重组	69.71	-	-	60,087	4,648,038.56	4,188,664.77	-
600783	鲁信创投	2015年12月31日	重要事项	39.07	2016年1月4日	37.60	104,993	3,519,645.56	4,102,076.51	-
601717	郑煤机	2015年12月18日	重大资产重组	7.52	-	-	368,519	3,350,849.21	2,771,262.88	-
002678	珠江钢琴	2015年12月21日	非公开发行	17.21	2016年1月19日	15.49	72,800	1,360,690.22	1,252,888.00	-

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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。从本基金所分拆的两类基金份额来看，国有企业改革 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；国有企业改革 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将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。

##### 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人海通证券开立于中国农业银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

### 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。本基金所持证券均在证券交易所上市，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，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	32,325,561.39	-	-	-	32,325,561.39
结算备付金	719,534.90	-	-	-	719,534.90
存出保证金	5,068,531.69	-	-	-	5,068,531.69
交易性金融资产	-	-	-	540,294,732.29	540,294,732.29
应收利息	-	-	-	7,297.19	7,297.19
应收申购款	-	-	-	32,185.11	32,185.11
资产总计	38,113,627.98	-	-	540,334,214.59	578,447,842.57
负债					
应付证券清算款	-	-	-	23,549,704.75	23,549,704.75
应付赎回款	-	-	-	3,645,167.51	3,645,167.51
应付管理人报酬	-	-	-	487,900.02	487,900.02
应付托管费	-	-	-	97,580.03	97,580.03
应付交易费用	-	-	-	715,486.82	715,486.82
其他负债	-	-	-	215,883.80	215,883.80
负债总计	-	-	-	28,711,722.93	28,711,722.93
利率敏感度缺口	38,113,627.98	-	-	511,622,491.66	549,736,119.64
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					

负债					
----	--	--	--	--	--

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。

本基金采用被动式指数化投资方法，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。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、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，力求降低跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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%。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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	540,294,732.29	98.28
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	540,294,732.29	98.28

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)
		本期末(2015年12月31日)
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 2,569
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 2,569

#### 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 500,764,220.17 元，属于第二层次的余额为 39,530,512.12 元，无属于第三层次的余额。

##### (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。

(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。

(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	540,294,732.29	93.40
	其中：股票	540,294,732.29	93.40
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	33,045,096.29	5.71
7	其他各项资产	5,108,013.99	0.88
8	合计	578,447,842.57	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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	1,005,238.00	0.18



B	采矿业	19,972,102.36	3.63
C	制造业	229,280,255.98	41.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,351,455.70	3.16
E	建筑业	33,023,634.71	6.01
F	批发和零售业	51,677,023.69	9.40
G	交通运输、仓储和邮政业	32,129,587.00	5.84
H	住宿和餐饮业	3,655,215.68	0.66
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,533,588.59	9.37
J	金融业	43,994,446.43	8.00
K	房地产业	20,406,344.10	3.71
L	租赁和商务服务业	19,819,561.94	3.61
M	科学研究和技术服务业	1,312,464.00	0.24
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	6,629,687.64	1.21
S	综合	4,102,076.51	0.75
	合计	535,892,682.33	97.48

### 8.2.2 期末积极投资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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,402,049.96	0.80
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		
J	金融业		
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
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		
S	综合		
	合计	4,402,049.96	0.80

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

### 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	600153	建发股份	1,553,000	22,813,570.00	4.15%
2	600637	东方明珠	438,456	16,613,097.84	3.02%
3	600050	中国联通	2,496,737	15,429,834.66	2.81%
4	601328	交通银行	2,386,221	15,367,263.24	2.80%
5	601390	中国中铁	1,352,100	14,764,932.00	2.69%
6	601989	中国重工	1,548,989	14,560,496.60	2.65%
7	601555	东吴证券	790,953	12,710,614.71	2.31%
8	601669	中国电建	1,511,037	12,133,627.11	2.21%
9	600085	同仁堂	251,134	11,203,087.74	2.04%
10	600009	上海机场	352,780	10,414,065.60	1.89%
11	000768	中航飞机	405,517	10,044,656.09	1.83%
12	000728	国元证券	431,572	9,749,211.48	1.77%

13	600118	中国卫星	216,500	9,209,910.00	1.68%
14	600406	国电南瑞	533,703	8,902,166.04	1.62%
15	601888	中国国旅	143,013	8,482,101.03	1.54%
16	600839	四川长虹	1,352,339	7,830,042.81	1.42%
17	600018	上港集团	1,188,082	7,698,771.36	1.40%
18	601106	中国一重	957,635	7,632,350.95	1.39%
19	600663	陆家嘴	149,238	7,482,793.32	1.36%
20	600023	浙能电力	996,100	7,460,789.00	1.36%
21	000568	泸州老窖	256,800	6,964,416.00	1.27%
22	000977	浪潮信息	210,916	6,688,146.36	1.22%
23	000425	徐工机械	1,556,500	6,615,125.00	1.20%
24	601718	际华集团	565,004	6,480,595.88	1.18%
25	600482	风帆股份	137,520	6,470,316.00	1.18%
26	600741	华域汽车	378,378	6,379,453.08	1.16%
27	600642	申能股份	833,454	6,292,577.70	1.14%
28	600643	爱建集团	420,980	6,167,357.00	1.12%
29	600820	隧道股份	575,665	6,125,075.60	1.11%
30	600875	东方电气	438,775	5,980,503.25	1.09%
31	600332	白云山	196,095	5,935,795.65	1.08%
32	000061	农产品	310,662	5,495,610.78	1.00%
33	600037	歌华有线	254,795	5,485,736.35	1.00%
34	600547	山东黄金	260,532	5,471,172.00	1.00%
35	600879	航天电子	304,500	5,441,415.00	0.99%
36	601918	国投新集	569,200	5,236,640.00	0.95%
37	000778	新兴铸管	800,500	5,195,245.00	0.95%
38	002368	太极股份	76,047	5,102,753.70	0.93%
39	002152	广电运通	164,203	5,088,650.97	0.93%
40	600827	百联股份	282,469	5,047,721.03	0.92%
41	000800	一汽轿车	298,008	4,878,390.96	0.89%
42	600312	平高电气	249,900	4,873,050.00	0.89%
43	600362	江西铜业	304,000	4,784,960.00	0.87%
44	600198	大唐电信	193,800	4,781,046.00	0.87%
45	600372	中航电子	193,300	4,760,979.00	0.87%
46	600418	江淮汽车	321,450	4,689,955.50	0.85%
47	000031	中粮地产	332,125	4,666,356.25	0.85%
48	600026	中海发展	500,960	4,628,870.40	0.84%
49	000581	威孚高科	183,808	4,551,086.08	0.83%
50	601928	凤凰传媒	279,548	4,453,199.64	0.81%
51	601992	金隅股份	458,091	4,292,312.67	0.78%

52	600704	物产中大	242,656	4,275,598.72	0.78%
53	000729	燕京啤酒	516,109	4,247,577.07	0.77%
54	000028	国药一致	60,087	4,188,664.77	0.76%
55	600783	鲁信创投	104,993	4,102,076.51	0.75%
56	600176	中国巨石	159,825	4,061,153.25	0.74%
57	601898	中煤能源	670,300	4,055,315.00	0.74%
58	600787	中储股份	402,752	4,043,630.08	0.74%
59	600511	国药股份	105,198	3,989,108.16	0.73%
60	000006	深振业 A	346,100	3,983,611.00	0.72%
61	600754	锦江股份	71,224	3,655,215.68	0.66%
62	600008	首创股份	353,100	3,598,089.00	0.65%
63	600648	外高桥	136,900	3,596,363.00	0.65%
64	600270	外运发展	132,676	3,590,212.56	0.65%
65	600597	光明乳业	225,300	3,586,776.00	0.65%
66	600835	上海机电	118,134	3,580,641.54	0.65%
67	600685	中船防务	90,200	3,580,038.00	0.65%
68	600426	华鲁恒升	244,500	3,528,135.00	0.64%
69	600161	天坛生物	94,400	3,297,392.00	0.60%
70	000758	中色股份	216,322	3,218,871.36	0.59%
71	600894	广日股份	157,429	3,147,005.71	0.57%
72	002344	海宁皮城	205,087	3,146,034.58	0.57%
73	600399	抚顺特钢	333,200	3,122,084.00	0.57%
74	600056	中国医药	185,356	3,082,470.28	0.56%
75	000801	四川九洲	93,627	2,895,883.11	0.53%
76	601717	郑煤机	368,519	2,771,262.88	0.50%
77	000851	高鸿股份	173,270	2,708,210.10	0.49%
78	002181	粤传媒	170,083	2,695,815.55	0.49%
79	600096	云天化	206,700	2,680,899.00	0.49%
80	600006	东风汽车	293,000	2,595,980.00	0.47%
81	000786	北新建材	207,100	2,464,490.00	0.45%
82	000528	柳工	288,432	2,391,101.28	0.44%
83	600559	老白干酒	38,531	2,318,410.27	0.42%
84	600606	绿地控股	133,641	2,182,357.53	0.40%
85	601801	皖新传媒	66,600	2,176,488.00	0.40%
86	600639	浦东金桥	93,400	2,091,226.00	0.38%
87	000501	鄂武商 A	96,866	2,072,932.40	0.38%
88	600395	盘江股份	242,400	1,990,104.00	0.36%
89	600848	上海临港	86,600	1,989,202.00	0.36%
90	600350	山东高速	246,700	1,754,037.00	0.32%

91	000987	广州友谊	65,709	1,720,918.71	0.31%
92	000523	广州浪奇	114,100	1,720,628.00	0.31%
93	300080	易成新能	147,300	1,586,421.00	0.29%
94	000596	古井贡酒	42,126	1,537,599.00	0.28%
95	300140	启源装备	53,600	1,334,640.00	0.24%
96	002116	中国海诚	73,900	1,312,464.00	0.24%
97	600858	银座股份	114,280	1,263,936.80	0.23%
98	002678	珠江钢琴	72,800	1,252,888.00	0.23%
99	600876	洛阳玻璃	36,600	1,175,592.00	0.21%
100	600975	新五丰	59,800	1,005,238.00	0.18%

### 8.3.2 期末积极投资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	600729	重庆百货	150,446	4,402,049.96	0.80

### 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	601328	交通银行	142,706,429.25	25.96
2	000768	中航飞机	139,884,739.47	25.45
3	601989	中国重工	136,628,864.99	24.85
4	601669	中国电建	131,568,177.14	23.93
5	600050	中国联通	128,865,186.80	23.44
6	600637	东方明珠	124,837,686.73	22.71
7	600839	四川长虹	113,045,362.97	20.56
8	000728	国元证券	97,448,187.05	17.73
9	601106	中国一重	92,813,740.42	16.88
10	600009	上海机场	83,964,315.74	15.27
11	600406	国电南瑞	83,503,490.81	15.19
12	601555	东吴证券	80,151,782.36	14.58

13	601888	中国国旅	73,446,144.10	13.36
14	600369	西南证券	71,887,199.41	13.08
15	600875	东方电气	69,317,211.39	12.61
16	600037	歌华有线	67,364,267.00	12.25
17	600085	同仁堂	64,176,678.87	11.67
18	600820	隧道股份	63,947,715.26	11.63
19	600642	申能股份	63,325,923.04	11.52
20	601607	上海医药	61,239,855.57	11.14
21	600018	上港集团	60,079,910.18	10.93
22	600663	陆家嘴	59,972,194.58	10.91
23	600741	华域汽车	56,786,343.42	10.33
24	601718	际华集团	55,873,786.08	10.16
25	000425	徐工机械	53,922,334.33	9.81
26	000977	浪潮信息	52,951,168.06	9.63
27	600332	白云山	52,352,723.14	9.52
28	600688	上海石化	52,001,663.48	9.46
29	000581	威孚高科	50,574,007.25	9.20
30	000800	一汽轿车	48,061,698.33	8.74
31	600547	山东黄金	47,975,409.88	8.73
32	002152	广电运通	46,119,229.29	8.39
33	000031	中粮地产	46,022,795.87	8.37
34	600827	百联股份	45,646,907.95	8.30
35	000061	农产品	45,610,131.63	8.30
36	601918	国投新集	42,805,567.60	7.79
37	600704	物产中大	39,776,414.97	7.24
38	000729	燕京啤酒	38,660,016.51	7.03
39	600787	中储股份	38,403,454.64	6.99
40	601928	凤凰传媒	37,993,693.87	6.91
41	600008	首创股份	37,366,310.33	6.80
42	600026	中海发展	37,317,136.17	6.79
43	600511	国药股份	35,960,699.26	6.54
44	600176	中国巨石	34,611,044.55	6.30
45	600153	建发股份	34,493,783.25	6.27
46	601992	金隅股份	33,644,993.06	6.12
47	000758	中色股份	32,928,816.80	5.99
48	002344	海宁皮城	32,659,273.64	5.94

49	000960	锡业股份	32,584,733.50	5.93
50	600783	鲁信创投	31,304,240.93	5.69
51	600270	外运发展	30,534,673.82	5.55
52	600835	上海机电	30,215,532.15	5.50
53	002051	中工国际	29,140,706.16	5.30
54	600056	中国医药	28,530,588.84	5.19
55	601717	郑煤机	28,514,545.51	5.19
56	600597	光明乳业	28,080,806.43	5.11
57	000958	东方能源	26,907,095.41	4.89
58	000528	柳工	25,930,576.86	4.72
59	000028	国药一致	23,984,582.09	4.36
60	600418	江淮汽车	23,661,612.49	4.30
61	600606	绿地控股	23,638,276.83	4.30
62	601238	广汽集团	23,331,774.22	4.24
63	600713	南京医药	22,843,897.91	4.16
64	600019	宝钢股份	22,157,230.70	4.03
65	600559	老白干酒	21,259,849.06	3.87
66	600894	广日股份	21,152,287.07	3.85
67	000851	高鸿股份	20,157,095.54	3.67
68	600643	爱建集团	20,096,292.16	3.66
69	000969	安泰科技	19,668,602.58	3.58
70	002268	卫士通	19,216,955.04	3.50
71	002181	粤传媒	19,019,730.53	3.46
72	002100	天康生物	18,217,088.54	3.31
73	600639	浦东金桥	18,109,712.65	3.29
74	601158	重庆水务	17,478,817.64	3.18
75	000733	振华科技	17,395,636.40	3.16
76	601390	中国中铁	16,981,723.10	3.09
77	600023	浙能电力	16,880,830.89	3.07
78	601801	皖新传媒	15,943,186.17	2.90
79	600526	菲达环保	15,497,716.98	2.82
80	600312	平高电气	15,465,372.07	2.81
81	600776	东方通信	14,825,363.74	2.70
82	000987	广州友谊	14,728,559.88	2.68
83	000860	顺鑫农业	14,654,379.08	2.67
84	600850	华东电脑	14,467,789.79	2.63

85	000778	新兴铸管	14,148,504.17	2.57
86	600686	金龙汽车	13,684,368.69	2.49
87	600482	风帆股份	12,825,423.35	2.33
88	000596	古井贡酒	12,618,216.46	2.30
89	600879	航天电子	11,936,238.00	2.17

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	601328	交通银行	109,080,861.10	19.84
2	000768	中航飞机	103,368,035.97	18.80
3	601989	中国重工	95,886,389.49	17.44
4	600050	中国联通	95,645,687.24	17.40
5	601669	中国电建	93,748,690.60	17.05
6	600637	东方明珠	81,557,416.96	14.84
7	600839	四川长虹	72,370,331.95	13.16
8	600009	上海机场	66,490,802.80	12.10
9	000728	国元证券	64,629,166.06	11.76
10	601106	中国一重	62,615,387.09	11.39
11	600369	西南证券	58,983,208.31	10.73
12	600406	国电南瑞	57,936,704.68	10.54
13	601888	中国国旅	55,645,789.38	10.12
14	601555	东吴证券	53,469,247.47	9.73
15	601607	上海医药	52,626,725.90	9.57
16	601718	际华集团	48,403,203.09	8.80
17	600085	同仁堂	47,127,400.47	8.57
18	600820	隧道股份	46,141,987.34	8.39
19	600018	上港集团	45,957,668.72	8.36
20	600642	申能股份	45,645,383.38	8.30
21	600663	陆家嘴	45,439,254.50	8.27
22	600875	东方电气	44,774,103.71	8.14
23	600688	上海石化	43,126,505.55	7.84
24	600037	歌华有线	42,983,934.86	7.82
25	600741	华域汽车	41,802,552.64	7.60
26	000425	徐工机械	40,068,613.53	7.29



27	600332	白云山	39,146,734.14	7.12
28	000977	浪潮信息	38,204,412.72	6.95
29	000581	威孚高科	36,987,071.04	6.73
30	000031	中粮地产	34,910,349.05	6.35
31	600827	百联股份	34,244,480.56	6.23
32	002152	广电运通	34,148,068.00	6.21
33	000800	一汽轿车	32,377,603.62	5.89
34	600547	山东黄金	31,933,715.45	5.81
35	000061	农产品	31,472,974.67	5.73
36	601918	国投新集	29,409,566.90	5.35
37	000729	燕京啤酒	28,781,218.96	5.24
38	600026	中海发展	26,624,126.24	4.84
39	600176	中国巨石	26,409,850.31	4.80
40	600511	国药股份	25,918,790.75	4.71
41	600787	中储股份	25,804,777.26	4.69
42	601928	凤凰传媒	25,490,622.86	4.64
43	600008	首创股份	24,724,890.31	4.50
44	600704	物产中大	24,438,483.64	4.45
45	601992	金隅股份	24,089,272.40	4.38
46	601238	广汽集团	23,923,346.80	4.35
47	600835	上海机电	23,328,235.73	4.24
48	000960	锡业股份	22,999,242.30	4.18
49	000758	中色股份	22,736,286.82	4.14
50	600270	外运发展	22,047,571.27	4.01
51	002344	海宁皮城	21,691,030.53	3.95
52	600019	宝钢股份	21,555,182.94	3.92
53	000958	东方能源	21,198,532.01	3.86
54	002051	中工国际	21,036,054.92	3.83
55	600056	中国医药	20,560,666.90	3.74
56	600783	鲁信创投	18,998,298.32	3.46
57	600597	光明乳业	18,396,540.31	3.35
58	601717	郑煤机	18,128,631.69	3.30
59	000528	柳工	17,992,166.65	3.27
60	002268	卫士通	17,371,223.43	3.16
61	000028	国药一致	16,764,885.18	3.05
62	600418	江淮汽车	16,430,926.05	2.99
63	600713	南京医药	15,928,204.04	2.90
64	002100	天康生物	15,187,706.81	2.76

65	601158	重庆水务	15,140,684.67	2.75
66	600894	广日股份	14,909,096.86	2.71
67	000969	安泰科技	14,781,005.84	2.69
68	600559	老白干酒	14,756,457.13	2.68
69	600606	绿地控股	14,416,665.11	2.62
70	000733	振华科技	14,248,763.83	2.59
71	000851	高鸿股份	13,216,718.18	2.40
72	000860	顺鑫农业	12,764,029.45	2.32
73	600639	浦东金桥	12,757,536.37	2.32
74	002181	粤传媒	12,660,148.47	2.30
75	601801	皖新传媒	11,517,201.66	2.10

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	4,211,826,788.99
卖出股票收入（成交）总额	2,942,935,804.14

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,068,531.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,297.19
5	应收申购款	32,185.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,108,013.99

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600153	建发股份	22,813,570.00	4.15	资产重组停牌

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600729	重庆百货	4,402,049.96	0.80	资产重组停牌

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
南方中证国有企业改革指数分级	7,344	33,859.49	74,713,482.11	30.05%	173,950,612.96	69.95%
改革 A	809	169,186.34	122,269,418.00	89.33%	14,602,333.00	10.67%
改革 B	6,314	21,677.50	5,636,720.00	4.12%	131,235,031.00	95.88%
合计	14,467	36,110.29	202,619,620.11	38.79%	319,787,976.96	61.21%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

改革 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	工银安盛人寿保险有限公司	42,677,528.00	31.18%
2	泰康人寿保险股份有限公司—投连—积极成长	19,101,290.00	13.96%
3	中油财务有限责任公司	18,356,825.00	13.41%
4	中国人民财产保险股份有限公司—自有资金	14,699,073.00	10.74%
5	中国银河证券股份有限公司	12,969,703.00	9.48%
6	中意人寿保险有限公司	4,572,213.00	3.34%
7	北京快快网络技术有限公司	4,033,228.00	2.95%
8	北京奥通达投资咨询有限公司	1,887,206.00	1.38%
9	李怡名	1,170,000.00	0.85%
10	国泰君安证券资管—招商银行—国泰君安君享弘利三号集合资产管	689,350.00	0.50%

改革 B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	陈霖	4,231,858.00	3.09%
2	吴允升	1,855,000.00	1.36%
3	黄楠	1,620,000.00	1.18%

4	信达证券—建行—信达满堂红基金 优选集合资产管理计划	1,600,000.00	1.17%
5	上海明沘投资管理有限公司—明沘 CTA 一号基金	1,309,803.00	0.96%
6	潘昂	1,180,946.00	0.86%
7	李怡名	1,170,933.00	0.86%
8	梁国华	1,159,065.00	0.85%
9	胡秀英	1,096,505.00	0.80%
10	赵成金	1,000,000.00	0.73%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	南方中证国有企业 改革指数分级	41,226.42	0.0166%
	改革 A	0.00	-
	改革 B	0.00	-
	合计	41,226.42	0.0079%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	南方中证国有企业改 革指数分级	0
	改革 A	0
	改革 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	南方中证国有企业改 革指数分级	0
	改革 A	0
	改革 B	0
	合计	0

注：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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证国有企业改革指数分级	改革 A	改革 B
基金合同生效日（2015 年 6 月 3 日）基金份额总额	228,097,334.36	320,318,311.00	320,318,312.00
本报告期期初基金份额总额	228,097,334.36	320,318,311.00	320,318,312.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,823,744,884.08	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,260,090,252.96	-	-
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）	-543,087,870.41	-183,446,560.00	-183,446,561.00
本报告期期末基金份额总额	248,664,095.07	136,871,751.00	136,871,751.00

注：拆分变动份额包括本基金三级份额的配对转换份额及折算份额。

## § 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。

本基金托管人 2015 年 7 月 17 日发布《关于海通证券基金托管部高级管理人员变更的公告》，海通证券股份有限公司基金托管部总经理朱元元同志于 2015 年 7 月 16 日离任。

本基金托管人 2015 年 8 月 10 日发布《关于海通证券基金托管部高级管理人员变更的公告》，海通证券股份有限公司于 2015 年 8 月 6 日起任命凌如水同志为基金托管部总经理。

### 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

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 91,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 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	
海通证券	2	27,154,762,593.13	100.00%	715,486.82	100.00%	-

注：本基金本报告期租用海通证券 2 个交易单元。

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交易单元的选择标准和程序：

A: 选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、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；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、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：

- 1、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；

- 2、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；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方中证国企改革:南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行基金定投、基金组合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12月31日
2	南方中证国企改革: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
3	南方中证国企改革:南方基金关于网上直销汇款交易申购南方安心保本基金费率为0的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月26日
4	南方中证国企改革: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23日
5	南方中证国企改革:关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月18日
6	南方中证国企改革: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
7	南方中证国企改革:南方基金关于开通顺手付交易平台基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月15日
8	南方中证国企改革: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
9	南方中证国企改革: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
10	南方中证国企改革: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



11	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 3 日
12	南方中证国企改革:关于南方基金管理有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 26 日
13	南方中证国企改革: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
14	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于电子直销业务调整通联支付申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 23 日
15	南方中证国企改革:南方基金关于旗下部分基金增加成都农商银行作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 11 月 18 日
16	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于免收旗下部分分级基金之基础份额的场内申购费的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 12 日
17	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 10 日
18	南方中证国企改革: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
19	南方中证国企改革: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 11 月 9 日
20	南方中证国企改革:南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
21	南方中证国企改革:关于南方基金公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 6 日
22	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 5 日
23	南方中证国企改革: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
24	南方中证国企改革:2015 年第三季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 27 日
25	南方中证国企改革:南方基金关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 21 日
26	南方中证国企改革:南方基金关于旗下部分基金增加新兰德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 20 日

27	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 20 日
28	南方中证国企改革: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
29	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 16 日
30	南方中证国企改革:南方基金关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 10 日
31	南方中证国企改革: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
32	南方中证国企改革:南方基金旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 16 日
33	南方中证国企改革: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公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 12 日
34	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于中信浙江并入中信证券期间基金业务安排的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 27 日
35	南方中证国企改革:关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 27 日
36	南方中证国企改革:南方基金关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 26 日
37	南方中证国企改革:南方基金关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 25 日
38	南方中证国企改革:南方基金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
39	南方中证国企改革: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 8 月 14 日
40	南方中证国企改革:关于苏宁金融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 8 月 14 日
41	南方中证国企改革:南方基金关于旗下部分基金增加中国农业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 8 月 13 日
42	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于旗下基金参加天天基金网费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 13 日
43	南方中证国企改革:南方基金关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 11 日
44	南方中证国企改革:关于中信浙江并入中信证券期间基金业务安排的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 11 日
45	南方中证国企改革: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

46	南方中证国企改革:关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月4日
47	南方中证国企改革:南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行网上银行、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8月3日
48	南方中证国企改革: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
49	南方中证国企改革: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
50	南方中证国企改革:关于旗下部分基金增加江南农村商业银行、第一创业、大连银行、青岛银行和包商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30日
51	南方中证国企改革:南方基金关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月28日
52	南方中证国企改革: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
53	南方中证国企改革: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23日
54	南方中证国企改革: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
55	南方中证国企改革: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22日
56	南方中证国企改革: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21日
57	南方中证国企改革: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
58	南方中证国企改革: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
59	南方中证国企改革: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18日
60	南方中证国企改革:关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月15日
61	南方中证国企改革:关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月15日
62	南方中证国企改革:关于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
63	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月13日

	恢复交易的公告		
64	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金不定期份额折算前收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 13 日
65	南方中证国企改革: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 11 日
66	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 178	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 10 日
67	南方中证国企改革:南方基金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
68	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间改革 A、改革 B 停复牌公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 10 日
69	南方中证国企改革: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
70	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金不定期份额折算公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 9 日
71	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金 B 类份额不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 9 日
72	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 8 日
73	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第一次风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 8 日
74	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司关于苏宁易购电子交易平台调整费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 7 日
75	南方中证国企改革:南方基金关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 7 日
76	南方中证国企改革:南方基金管理有限公司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 4 日
77	南方中证国企改革:关于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 7 月 3 日
78	南方中证国企改革:南方基金关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 2 日
79	南方中证国企改革:关于临时调整实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 1 日
80	南方中证国企改革: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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 1 日

	银行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		
81	南方中证国企改革:关于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
82	南方中证国企改革:南方基金关于继续开展直销柜台指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 25 日
83	南方中证国企改革:南方基金关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 20 日
84	南方中证国企改革:关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 19 日
85	南方中证国企改革:份额上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 15 日
86	南方中证国企改革:关于开通南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金转托管及份额配对转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 10 日
87	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 10 日
88	南方中证国企改革:上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 10 日
89	南方中证国企改革: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
90	南方中证国企改革:关于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 4 日
91	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 4 日
92	南方中证国企改革:关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 3 日
93	南方中证国企改革:关于旗下部分基金增加宜信普泽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 6 月 1 日
94	南方中证国企改革:南方基金关于临时调整实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 29 日
95	南方中证国企改革:南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 29 日
96	南方中证国企改革: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
97	南方中证国企改革:南方基金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 28 日
98	南方中证国企改革: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
99	南方中证国企改革:南方基金关于南方改革基金增加兴业银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 27 日

100	南方中证国企改革: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
101	南方中证国企改革:招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 25 日
102	南方中证国企改革:上网发售提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 25 日
103	南方中证国企改革:基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 25 日
104	南方中证国企改革:基金合同内容摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 25 日
105	南方中证国企改革:基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 25 日
106	南方中证国企改革:基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 25 日
107	南方中证国企改革:南方基金关于网上直销汇款交易认购南方中证国有企业改革指数分级基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 22 日
108	南方中证国企改革:招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 22 日
109	南方中证国企改革:托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 22 日
110	南方中证国企改革:基金合同内容摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 22 日
111	南方中证国企改革:基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 22 日
112	南方中证国企改革:基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 22 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金的文件。
- 2、《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、《南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金 2015 年年度报告》原文
- 5、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

## 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>