

中国梦灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告(摘要)

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中国梦灵活配置混合
基金主代码	000554
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 9 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	238,690,029.68 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“中国梦基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	以上市公司基本面研究作为基础，通过专业化研究分析，积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会，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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置

	风险监控, 适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
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
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年 6 月 9 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	96,835,771.27	35,224,208.51
本期利润	96,222,634.55	49,153,009.06
加权平均基金份额本期利润	0.3303	0.0595
本期基金份额净值增长率	47.22%	6.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2995	0.0630
期末基金资产净值	373,457,937.52	299,101,430.34

期末基金份额净值	1.565	1.063
----------	-------	-------

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。

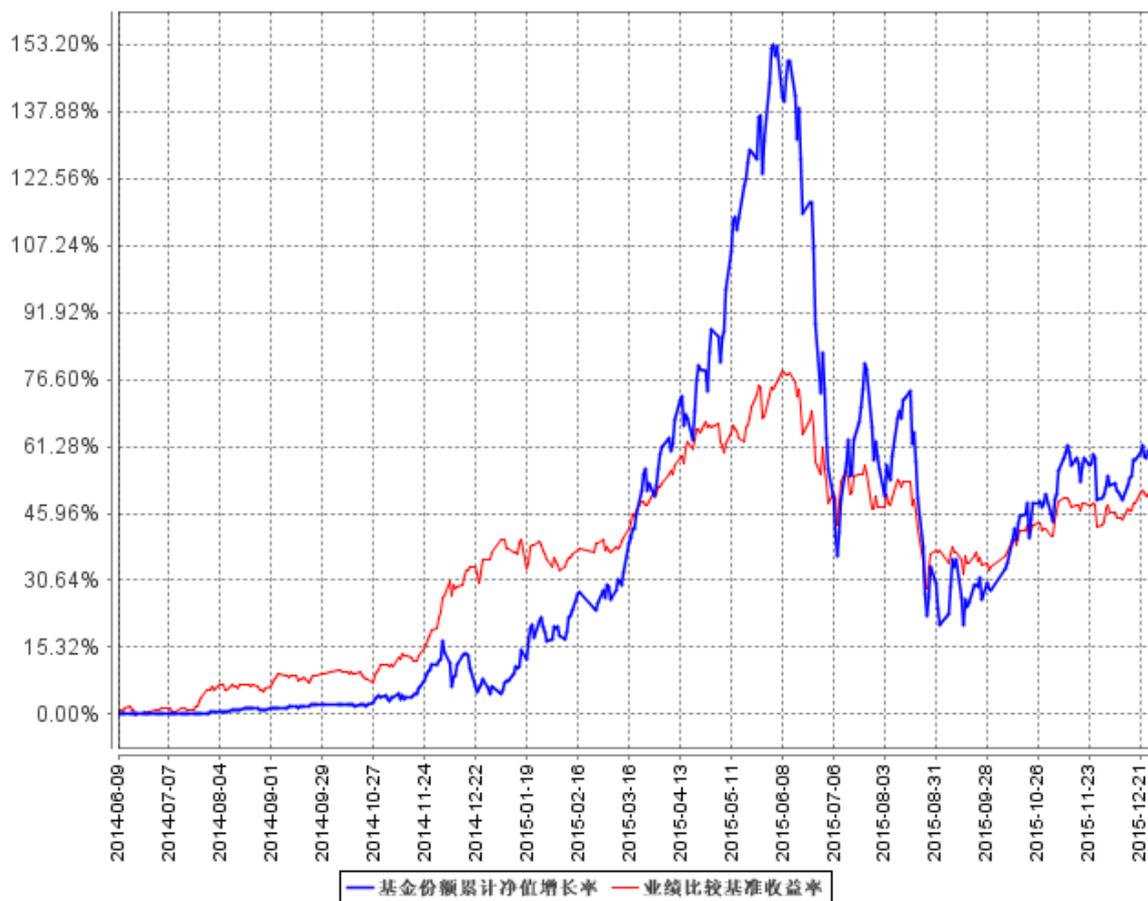
3.2 基金净值表现

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	21.98%	1.90%	10.65%	1.01%	11.33%	0.89%
过去六个月	-14.29%	3.11%	-8.15%	1.61%	-6.14%	1.50%
过去一年	47.22%	2.91%	7.74%	1.49%	39.48%	1.42%
自基金合同生效起至今	56.50%	2.37%	47.88%	1.28%	8.62%	1.09%

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

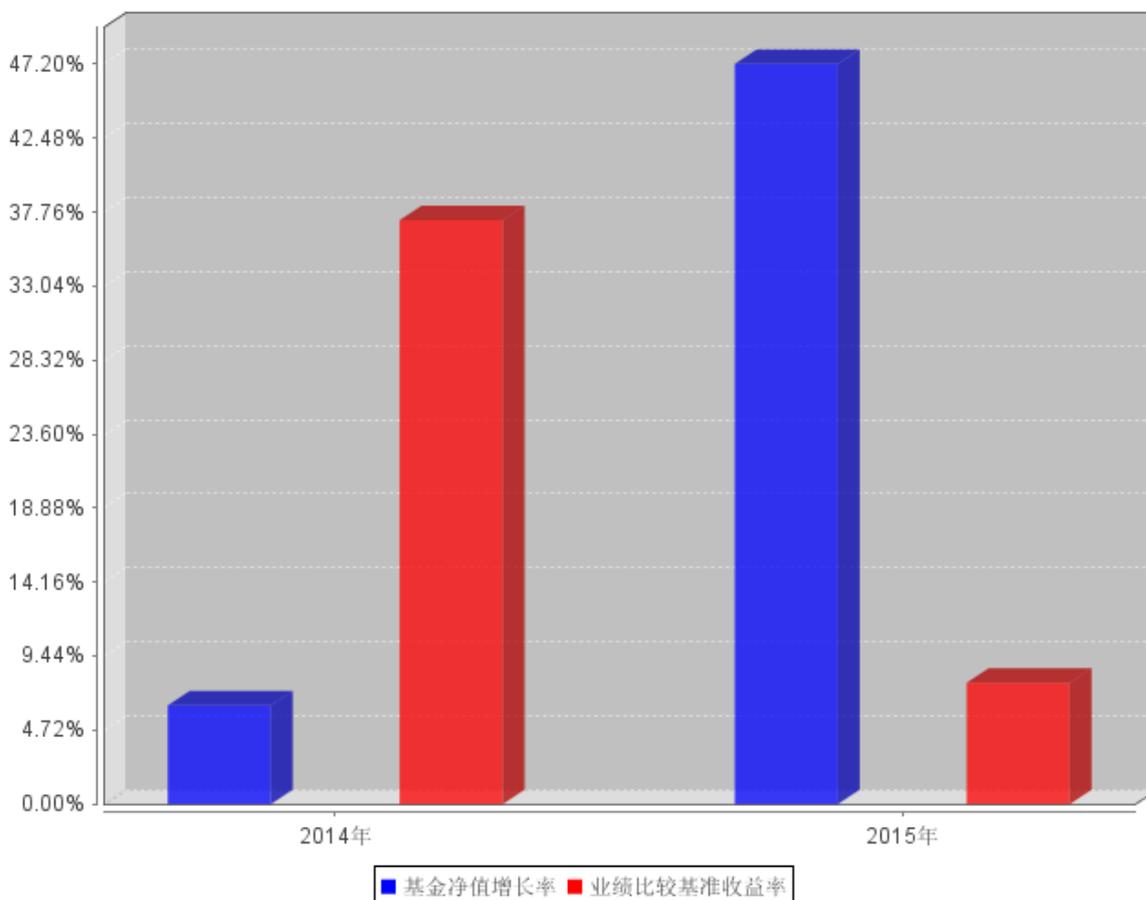
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

过往三年本基金未有利润分配事项。

§ 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		
蔡望鹏	本基金基金经理	2015 年 7 月 24 日	-	7 年	清华大学固体力学专业硕士学历，具有基金从业资格。2008 年 4 月至 2013 年 2 月，担任博时基金管理有限公司机械行业研究员；2013 年 2 月加入南方基金，担任南方稳健、南方稳健二号的基金经理助理；2015 年 1 月至今，任南方积配基金经理；2015 年 7 月至今，任南方中国梦基金经理。
彭砚	本基金基金经理	2014 年 6 月 9 日	2015 年 7 月 24 日	9 年	南开大学金融学硕士，具有基金从业资格。曾任中银基金管理有限公司研究员、中银优选基金基金经理助理、助理副总裁 (AVP) 等职务；2010 年 6 月至 2013 年 5 月，任中银策略基金基金经理；2010 年 8 月至 2013 年 5 月，任中银价值基金基金经理。2013 年 6 月加入南方基金，2014 年 1 月至 2015 年 7 月，担任南方隆元基金经理；2014 年 6 月至 2015 年 7 月，任南方中国梦基金经理。
黄俊	本基金基金经理助理	2015 年 2 月 26 日	2015 年 11 月 2 日	6 年	中国人民银行研究生部金融学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于中国期货保证金监控中心、瀚信资产管理有限公司、深圳盈泰投资管理有限公司，2012 年 5 月加入南方基金，任研究部研究员，负责宏观、策略的研究；2015 年 2 月至 2015 年 11 月，担任南方隆元、南方中国梦基金经理助理。2015 年 11 月至今，任南方消费活力基金经理。

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

定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《中国梦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，两两组间单日、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

本年度市场经历了大幅的上涨和下跌。上半年市场呈现明显牛市特征，伴随着证券开户数增加及资金流入，个股呈现明显泡沫化。此后在 6 月份和 8 月份由于清理场外配资，市场大幅回调，并在 4 季度迎来大幅的反弹。

本基金于 2015 年 7 月变更基金经理，在 4 季度维持了谨慎的仓位，主要由于个股的高估值风险。回顾市场全年的表现，在经历了大起大落后，有两种类型股票在全年依然取得了明显的超额收益，一种是业绩稳定高成长的白马股，主要分布在消费领域，如定制家具、低价航空、时尚消费等；另一种是代表了新技术发展方向的龙头企业，主要分布在云计算、互联网、新能源汽车等行业。市场对经济转型形成了较为一致的预期，市场起落之后资金仍然追逐代表未来的新经济领域，其中的差别只在于对于个股的判断，选择未来可能成为龙头的企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本期基金净值上涨 47.22%，业绩基准上涨 7.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年度宏观经济最大的主题就是供给侧改革，判断经济层面将有一次较为深度的出清，同时为了对冲因此带来的经济下滑，财政和货币政策将较为宽松，这个过程将贯穿全年。两个相对矛盾的逻辑作用下，2016 年市场的不确定性将增加。因此，本基金在 2016 年的配置将相对趋于谨慎，更多选择基本面增长确定性较高的成长股进行配置，同时筛选代表新经济方向的标的重点配置，如果市场有较大调整，我们将提高这方面的仓位。同时在整体的仓位上，全年将维持中性偏高，不会在仓位上做过多调整。

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

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中国梦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，中国梦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中国梦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，中国梦灵活配置混合型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中国梦灵活配置混合型证券投资基金 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

本基金 2015 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2016)第 21279 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中国梦灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	34,519,860.40	70,823,860.52

结算备付金	2,385,797.43	5,990,958.19
存出保证金	508,515.26	202,696.58
交易性金融资产	337,562,676.55	166,188,907.79
其中：股票投资	327,550,676.55	166,188,907.79
基金投资	-	-
债券投资	10,012,000.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	60,659,176.19
应收利息	335,375.90	25,492.49
应收股利	-	-
应收申购款	292,957.80	36,294.95
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	375,605,183.34	303,927,386.71
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015年12月31日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	599,131.72	3,228,702.68
应付管理人报酬	487,221.17	453,708.78
应付托管费	81,203.50	75,618.13
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	823,063.42	864,863.34
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	156,626.01	203,063.44
负债合计	2,147,245.82	4,825,956.37
所有者权益：		
实收基金	238,690,029.68	281,369,717.04
未分配利润	134,767,907.84	17,731,713.30
所有者权益合计	373,457,937.52	299,101,430.34
负债和所有者权益总计	375,605,183.34	303,927,386.71

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.565 元，基金份额总额 238,690,029.68 份。

7.2 利润表

会计主体：中国梦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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 6 月 9 日(基金合同生效 日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	111,629,944.87	59,514,354.26
1. 利息收入	899,151.53	9,007,562.02
其中：存款利息收入	593,531.74	1,757,389.04
债券利息收入	300,175.34	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,444.45	7,250,172.98
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	104,190,092.76	33,875,912.07
其中：股票投资收益	103,289,504.67	33,645,011.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	900,588.09	230,900.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-613,136.72	13,928,800.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7,153,837.30	2,702,079.62
减：二、费用	15,407,310.32	10,361,345.20
1. 管理人报酬	7,128,790.36	7,005,491.76
2. 托管费	1,188,131.81	1,167,582.01
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,716,218.54	1,943,016.60
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	374,169.61	245,254.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	96,222,634.55	49,153,009.06
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	96,222,634.55	49,153,009.06

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中国梦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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	281,369,717.04	17,731,713.30	299,101,430.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	96,222,634.55	96,222,634.55
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）	-42,679,687.36	20,813,559.99	-21,866,127.37
其中：1. 基金申购款	773,906,336.91	640,852,782.88	1,414,759,119.79
2. 基金赎回款	-816,586,024.27	-620,039,222.89	-1,436,625,247.16
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）	238,690,029.68	134,767,907.84	373,457,937.52
项目	上年度可比期间 2014 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,194,190,882.26	-	1,194,190,882.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,153,009.06	49,153,009.06
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）	-912,821,165.22	-31,421,295.76	-944,242,460.98
其中：1. 基金申购款	52,866,756.62	4,106,251.17	56,973,007.79
2. 基金赎回款	-965,687,921.84	-35,527,546.93	-1,001,215,468.77
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）	281,369,717.04	17,731,713.30	299,101,430.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

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

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 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证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.1.3 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。

7.4.2 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》、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。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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
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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	1,103,089,285.62	24.61%	265,389,416.53	20.04%
兴业证券	209,047,659.35	4.66%	38,875,531.27	2.94%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	977,314.24	24.27%	41,069.91	4.99%
兴业证券	184,986.99	4.59%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	234,843.35	19.85%	232,542.78	26.89%
兴业证券	34,401.09	2.91%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 6 月 9 日(基金合同生 效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,128,790.36	7,005,491.76
其中：支付销售机构的客户维护费	1,919,714.19	1,796,244.36

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 6 月 9 日(基金合同生 效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,188,131.81	1,167,582.01

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 6 月 9 日(基金合同生 效日)至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日 (2014 年 6 月 9 日) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	6,683,823.52	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,683,823.52	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.8000%	-

注: 基金管理人南方基金在本年度申购本基金的交易委托华泰证券办理, 适用费率为每笔人民币 1,000.00 元。

7.4.4.4.2 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

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方 名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	34,519,860.40	549,120.49	70,823,860.52	1,498,282.91

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 利润分配情况

无。

7.4.6 期末 (2015 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位: 股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备 注

603456	九洲药业	2015年12月7日	2016年12月5日	非公开发行 流通受限	58.00	59.03	40,000	2,320,000.00	2,361,200.00	-
--------	------	------------	------------	---------------	-------	-------	--------	--------------	--------------	---

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.6.2 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
600645	中源协和	2015年12月30日	重大事项	65.01	2016年1月4日	63.90	114,400	7,068,262.27	7,437,144.00	-
600122	宏图高科	2015年12月25日	重大事项	19.42	-	-	203,300	3,783,595.00	3,948,086.00	-
300063	天龙集团	2015年12月22日	重大资产重组	43.33	-	-	87,100	3,778,827.07	3,774,043.00	-
300011	鼎汉技术	2015年12月31日	重大事项	29.80	2016年1月22日	26.82	105,094	3,061,957.19	3,131,801.20	-
002053	云南盐化	2015年11月19日	重大事项	25.84	2016年3月14日	23.26	80,600	1,863,873.00	2,082,704.00	-
300054	鼎龙股份	2015年11月23日	重大资产重组	24.66	2016年3月14日	22.19	7,300	152,059.00	180,018.00	-

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。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§ 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	327,550,676.55	87.21

	其中：股票	327,550,676.55	87.21
2	固定收益投资	10,012,000.00	2.67
	其中：债券	10,012,000.00	2.67
	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	36,905,657.83	9.83
7	其他各项资产	1,136,848.96	0.30
8	合计	375,605,183.34	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,785,667.28	2.35
C	制造业	185,304,088.95	49.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,493,495.60	1.74
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,902,370.25	2.65
G	交通运输、仓储和邮政业	4,037,649.00	1.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,465,360.20	6.82
J	金融业	64,150,318.27	17.18
K	房地产业	3,587,436.00	0.96
L	租赁和商务服务业	2,480,138.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	7,437,144.00	1.99
N	水利、环境和公共设施管理业	3,581,600.00	0.96
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	3,709,860.00	0.99

S	综合	2,615,549.00	0.70
	合计	327,550,676.55	87.71

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600036	招商银行	1,056,673	19,009,547.27	5.09
2	600060	海信电器	953,800	18,761,246.00	5.02
3	002094	青岛金王	573,600	17,867,640.00	4.78
4	600030	中信证券	743,100	14,378,985.00	3.85
5	002367	康力电梯	852,500	14,296,425.00	3.83
6	601166	兴业银行	705,000	12,034,350.00	3.22
7	000666	经纬纺机	347,800	10,451,390.00	2.80
8	600476	湘邮科技	255,900	10,044,075.00	2.69
9	300102	乾照光电	900,400	9,472,208.00	2.54
10	002037	久联发展	317,400	8,811,024.00	2.36

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002589	瑞康医药	46,995,228.44	15.71
2	002366	台海核电	43,583,760.24	14.57
3	300253	卫宁软件	41,353,063.32	13.83
4	002260	德奥通航	40,069,352.64	13.40
5	002421	达实智能	36,447,968.20	12.19
6	002153	石基信息	35,408,187.88	11.84
7	002215	诺普信	34,745,530.43	11.62
8	002318	久立特材	34,708,685.44	11.60
9	300359	全通教育	33,725,184.40	11.28

10	002405	四维图新	32,920,540.70	11.01
11	300199	翰宇药业	32,829,207.68	10.98
12	000901	航天科技	32,733,271.30	10.94
13	300171	东富龙	32,562,355.35	10.89
14	002308	威创股份	31,995,467.31	10.70
15	002657	中科金财	29,250,020.25	9.78
16	300231	银信科技	28,916,442.53	9.67
17	002312	三泰控股	28,412,199.14	9.50
18	600446	金证股份	27,131,026.17	9.07
19	601166	兴业银行	26,164,823.28	8.75
20	300348	长亮科技	25,090,258.11	8.39
21	600804	鹏博士	25,008,965.86	8.36
22	600208	新湖中宝	24,823,889.80	8.30
23	601939	建设银行	24,420,158.59	8.16
24	300126	锐奇股份	24,127,823.00	8.07
25	600070	浙江富润	23,945,605.40	8.01
26	600036	招商银行	23,805,867.08	7.96
27	002175	东方网络	23,386,499.58	7.82
28	002367	康力电梯	23,352,428.26	7.81
29	600048	保利地产	22,947,175.37	7.67
30	300244	迪安诊断	22,822,804.48	7.63
31	300059	东方财富	22,265,735.00	7.44
32	600030	中信证券	22,140,631.60	7.40
33	600576	万家文化	21,803,889.60	7.29
34	002363	隆基机械	20,568,406.30	6.88
35	600358	国旅联合	20,507,517.11	6.86
36	600571	信雅达	19,786,262.15	6.62
37	002081	金螳螂	19,728,460.39	6.60
38	600060	海信电器	18,642,689.23	6.23
39	002253	川大智胜	17,179,244.21	5.74
40	002094	青岛金王	16,104,562.02	5.38
41	300130	新国都	16,103,149.76	5.38
42	601988	中国银行	15,781,271.50	5.28
43	300285	国瓷材料	15,744,262.00	5.26
44	300193	佳士科技	15,358,626.88	5.13
45	000100	TCL 集团	15,293,850.00	5.11

46	002465	海格通信	14,937,108.43	4.99
47	002292	奥飞动漫	14,911,763.44	4.99
48	600491	龙元建设	14,853,567.76	4.97
49	600518	康美药业	14,331,970.00	4.79
50	002609	捷顺科技	13,379,056.15	4.47
51	300058	蓝色光标	13,007,257.84	4.35
52	300347	泰格医药	12,901,928.40	4.31
53	000401	冀东水泥	12,697,691.71	4.25
54	002022	科华生物	12,432,653.44	4.16
55	300287	飞利信	12,432,241.04	4.16
56	000750	国海证券	11,654,539.00	3.90
57	300252	金信诺	11,561,604.89	3.87
58	002047	宝鹰股份	11,500,663.00	3.85
59	300144	宋城演艺	11,422,700.61	3.82
60	300383	光环新网	11,418,766.90	3.82
61	002400	省广股份	11,255,687.79	3.76
62	002551	尚荣医疗	11,117,653.22	3.72
63	300131	英唐智控	10,696,932.62	3.58
64	300024	机器人	10,532,874.73	3.52
65	601636	旗滨集团	10,532,684.00	3.52
66	600771	广誉远	10,509,462.68	3.51
67	000637	茂化实华	10,263,247.01	3.43
68	600587	新华医疗	10,251,334.66	3.43
69	600875	东方电气	10,212,532.37	3.41
70	600970	中材国际	10,181,301.00	3.40
71	600990	四创电子	10,012,431.73	3.35
72	600105	永鼎股份	9,786,755.97	3.27
73	002586	围海股份	9,705,213.85	3.24
74	002358	森源电气	9,624,223.24	3.22
75	002402	和而泰	9,586,665.63	3.21
76	002037	久联发展	9,526,185.13	3.18
77	002236	大华股份	9,504,454.56	3.18
78	002530	丰东股份	9,315,755.83	3.11
79	002462	嘉事堂	9,245,293.20	3.09
80	002044	江苏三友	9,156,991.05	3.06
81	002649	博彦科技	9,152,513.22	3.06

82	600749	西藏旅游	9,148,830.00	3.06
83	600077	宋都股份	8,886,837.50	2.97
84	002380	科远股份	8,634,868.58	2.89
85	300332	天壕环境	8,538,097.50	2.85
86	300102	乾照光电	8,276,223.73	2.77
87	600657	信达地产	8,226,201.54	2.75
88	002445	中南重工	8,217,694.00	2.75
89	600645	中源协和	8,209,712.00	2.74
90	601818	光大银行	8,137,149.00	2.72
91	002146	荣盛发展	8,058,020.00	2.69
92	600369	西南证券	8,056,319.00	2.69
93	600017	日照港	8,046,016.66	2.69
94	000697	炼石有色	7,913,858.40	2.65
95	002177	御银股份	7,871,502.92	2.63
96	300352	北信源	7,864,797.66	2.63
97	002394	联发股份	7,848,831.00	2.62
98	600837	海通证券	7,846,198.42	2.62
99	000712	锦龙股份	7,771,820.28	2.60
100	300049	福瑞股份	7,764,363.80	2.60
101	002230	科大讯飞	7,707,014.28	2.58
102	002354	天神娱乐	7,659,884.00	2.56
103	002572	索菲亚	7,638,722.36	2.55
104	300397	天和防务	7,597,115.64	2.54
105	000666	经纬纺机	7,570,819.84	2.53
106	601799	星宇股份	7,531,066.65	2.52
107	601099	太平洋	7,458,250.55	2.49
108	600476	湘邮科技	7,340,367.20	2.45
109	300070	碧水源	7,313,106.23	2.45
110	002141	蓉胜超微	7,282,085.30	2.43
111	300273	和佳股份	7,157,472.42	2.39
112	600010	包钢股份	7,098,658.00	2.37
113	000793	华闻传媒	6,983,982.96	2.33
114	300011	鼎汉技术	6,922,574.36	2.31
115	300203	聚光科技	6,487,475.48	2.17
116	600382	广东明珠	6,190,134.00	2.07
117	600588	用友网络	6,143,547.00	2.05

118	000681	视觉中国	6,016,376.64	2.01
-----	--------	------	--------------	------

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002318	久立特材	58,605,637.28	19.59
2	600446	金证股份	57,959,161.59	19.38
3	300253	卫宁软件	52,305,127.96	17.49
4	002366	台海核电	50,382,730.46	16.84
5	002589	瑞康医药	44,725,319.03	14.95
6	002153	石基信息	44,098,977.24	14.74
7	600208	新湖中宝	41,706,928.09	13.94
8	300359	全通教育	40,958,591.83	13.69
9	002260	德奥通航	35,719,939.22	11.94
10	002215	诺普信	35,227,963.73	11.78
11	000901	航天科技	34,034,483.67	11.38
12	600576	万家文化	33,371,992.90	11.16
13	002657	中科金财	32,714,790.07	10.94
14	300199	翰宇药业	31,656,080.64	10.58
15	300171	东富龙	30,031,406.52	10.04
16	002175	东方网络	29,463,589.06	9.85
17	300059	东方财富	28,804,870.26	9.63
18	600048	保利地产	26,918,242.61	9.00
19	300285	国瓷材料	26,643,922.80	8.91
20	600804	鹏博士	26,032,798.46	8.70
21	002308	威创股份	25,061,254.84	8.38
22	002421	达实智能	24,037,923.35	8.04
23	002081	金螳螂	23,782,125.23	7.95
24	002405	四维图新	22,734,686.62	7.60
25	002363	隆基机械	21,782,088.85	7.28
26	300231	银信科技	21,744,836.61	7.27
27	300244	迪安诊断	20,968,629.26	7.01
28	300126	锐奇股份	20,853,036.86	6.97
29	600358	国旅联合	19,956,782.78	6.67
30	601939	建设银行	19,805,531.57	6.62

31	300058	蓝色光标	19,470,207.08	6.51
32	300348	长亮科技	19,139,452.23	6.40
33	002312	三泰控股	19,081,442.23	6.38
34	300130	新国都	19,028,251.01	6.36
35	600070	浙江富润	18,664,784.06	6.24
36	600570	恒生电子	18,399,401.48	6.15
37	300252	金信诺	17,055,266.67	5.70
38	300193	佳士科技	16,777,517.39	5.61
39	300347	泰格医药	16,415,633.43	5.49
40	300287	飞利信	16,252,897.72	5.43
41	002253	川大智胜	16,123,148.90	5.39
42	600518	康美药业	15,939,819.92	5.33
43	300144	宋城演艺	15,803,042.44	5.28
44	000100	TCL 集团	15,160,827.27	5.07
45	601988	中国银行	15,105,124.10	5.05
46	600491	龙元建设	14,711,311.89	4.92
47	601166	兴业银行	14,704,049.00	4.92
48	300024	机器人	14,695,830.00	4.91
49	600571	信雅达	14,587,102.38	4.88
50	600105	永鼎股份	14,472,385.77	4.84
51	300131	英唐智控	13,930,755.15	4.66
52	002400	省广股份	13,381,114.57	4.47
53	002292	奥飞动漫	13,045,602.77	4.36
54	000750	国海证券	12,881,404.32	4.31
55	002380	科远股份	12,858,444.24	4.30
56	300078	思创医惠	12,584,986.20	4.21
57	002022	科华生物	12,185,828.53	4.07
58	002402	和而泰	12,048,194.24	4.03
59	300151	昌红科技	11,452,871.07	3.83
60	600970	中材国际	11,347,683.20	3.79
61	002018	华信国际	11,307,150.03	3.78
62	002609	捷顺科技	11,251,633.44	3.76
63	600030	中信证券	10,779,099.00	3.60
64	000637	茂化实华	10,509,452.65	3.51
65	300383	光环新网	10,458,277.88	3.50
66	600875	东方电气	10,407,397.48	3.48
67	002236	大华股份	10,292,752.70	3.44
68	601636	旗滨集团	10,198,262.53	3.41

69	300352	北信源	10,068,590.00	3.37
70	002649	博彦科技	9,937,614.40	3.32
71	601318	中国平安	9,934,345.28	3.32
72	300248	新开普	9,720,030.68	3.25
73	002465	海格通信	9,666,998.45	3.23
74	002358	森源电气	9,550,280.11	3.19
75	002551	尚荣医疗	9,148,398.72	3.06
76	002586	围海股份	9,087,719.78	3.04
77	002055	得润电子	9,013,725.82	3.01
78	600745	中茵股份	8,852,254.90	2.96
79	002047	宝鹰股份	8,841,565.36	2.96
80	002530	丰东股份	8,824,938.49	2.95
81	600749	西藏旅游	8,687,049.95	2.90
82	002462	嘉事堂	8,592,628.97	2.87
83	300049	福瑞股份	8,545,011.48	2.86
84	600771	广誉远	8,323,878.17	2.78
85	002146	荣盛发展	8,323,547.00	2.78
86	002044	江苏三友	8,288,778.34	2.77
87	300257	开山股份	8,153,928.78	2.73
88	000671	阳光城	8,113,099.62	2.71
89	600587	新华医疗	8,112,166.46	2.71
90	600017	日照港	8,089,726.26	2.70
91	002177	御银股份	8,079,818.38	2.70
92	600077	宋都股份	8,026,128.29	2.68
93	601099	太平洋	8,011,919.83	2.68
94	600657	信达地产	7,948,806.31	2.66
95	000401	冀东水泥	7,909,707.57	2.64
96	300030	阳普医疗	7,804,048.55	2.61
97	300380	安硕信息	7,677,974.56	2.57
98	600588	用友网络	7,665,904.00	2.56
99	000712	锦龙股份	7,652,779.41	2.56
100	600837	海通证券	7,650,545.96	2.56
101	300273	和佳股份	7,626,522.80	2.55
102	002354	天神娱乐	7,547,622.49	2.52
103	601799	星宇股份	7,510,387.47	2.51
104	000681	视觉中国	7,386,528.48	2.47
105	300332	天壕环境	7,352,036.30	2.46
106	300070	碧水源	6,997,374.40	2.34

107	300203	聚光科技	6,886,587.73	2.30
108	000793	华闻传媒	6,828,187.13	2.28
109	600382	广东明珠	6,800,452.22	2.27
110	002141	蓉胜超微	6,784,994.70	2.27
111	300336	新文化	6,745,240.99	2.26
112	000925	众合科技	6,564,785.93	2.19
113	600010	包钢股份	6,362,874.00	2.13
114	300075	数字政通	6,341,583.85	2.12
115	600990	四创电子	6,329,351.02	2.12
116	600728	佳都科技	6,086,508.10	2.03
117	000008	神州高铁	6,002,192.32	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,271,432,489.25
卖出股票收入（成交）总额	2,212,730,488.44

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,012,000.00	2.68
	其中：政策性金融债	10,012,000.00	2.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,012,000.00	2.68

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150202	15 国开 02	100,000	10,012,000.00	2.68

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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 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。

8.11 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。

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	508,515.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	335,375.90
5	应收申购款	292,957.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,136,848.96

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
20,963	11,386.25	29,142,446.93	12.21%	209,547,582.75	87.79%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	162,929.79	0.0683%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

基金合同生效日（2014年6月9日）基金份额总额	1,194,190,882.26
本报告期期初基金份额总额	281,369,717.04
本报告期基金总申购份额	773,906,336.91
减:本报告期基金总赎回份额	816,586,024.27
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	238,690,029.68

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内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55,000元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为2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	1,218,109,021.69	27.18%	1,100,923.78	27.33%	新增
华泰证券	1	1,103,089,285.62	24.61%	977,314.24	24.27%	-
中信建投	1	902,972,579.63	20.15%	799,041.17	19.84%	-
华龙证券	1	342,995,631.07	7.65%	317,953.02	7.89%	新增
瑞银证券	1	320,950,778.03	7.16%	293,560.48	7.29%	-
兴业证券	1	209,047,659.35	4.66%	184,986.99	4.59%	-
招商证券	1	111,930,656.45	2.50%	102,791.34	2.55%	-
安信证券	1	109,516,131.37	2.44%	101,992.42	2.53%	新增
西南证券	1	83,386,505.77	1.86%	76,366.97	1.90%	-
东兴证券	1	79,844,728.71	1.78%	72,690.39	1.80%	-

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。

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	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	70,000,000.00	100.00%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-