

序号		项目	金额	金额单位：人民币元 占基金总资产的比例(%)
1	权益投资			-
2	其中：股票			-
3	固定收益投资		2,169,440,785.58	93.15

			比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,169,440,785.58	93.19

	其中：债券	2,169,440,785.58	93.19
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	57,988,213.33	2.45
6	其他各项资产	100,453,577.41	4.32

7	合计	2,327,882,576.32	100.00
8.2	期末按行业分类的股票投资组合		
	本基金本报告期末未持有股票。		
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		
	本基金本报告期末未持有股票。		
8.4	报告期末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		

金源单位:人民币				
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	002685	华东重机	24,975,000.00	3.14
2	002689	博林特	24,000,000.00	3.02
3	002677	浙江美大	24,000,000.00	3.02
4	002668	奥马电器	18,150,000.00	2.28

5	002673	西部证券	17,400,000.00	2.19
6	002669	康达新材	15,000,000.00	1.89
7	300330	华虹计通	15,000,000.00	1.89
8	601929	吉视传媒	9,800,000.00	1.23
9	601965	中国汽研	7,547,452.20	0.95
10	603173	翠微股份	5,931,522.00	0.75

11	000651	格力电器	3,432,000.00	0.43
12	603128	华贸物流	3,108,967.92	0.39
13	603000	人民网	1,776,600.00	0.22
14	601800	中国交建	37,800.00	0.00

注：买入包括一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，买入金额按照金额/成交单价乘以成交数量)排列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细					金额单位:人民币元
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)	
1	002635	安洁科技	31,093,613.15	3.91	
2	002673	西部证券	27,607,386.07	3.47	
3	002677	浙江美大	26,542,976.59	3.34	

4	002689	博林特	21,656,767.00	2.72
5	002685	华东重机	20,235,311.45	2.55
6	002668	奥马电器	19,312,296.74	2.43
7	300330	华虹计通	15,878,966.20	2.00
8	002627	宜昌交运	15,830,168.69	1.99
9	002660	康达新材	12,644,771.40	1.20

9	600269	康达新材	13,344,771.49	1.70
10	601929	吉视传媒	12,020,930.00	1.51
11	601028	玉龙股份	9,168,131.09	1.15
12	601555	东吴证券	8,265,097.22	1.04
13	601965	中国汽研	6,260,864.09	0.79
14	603123	翠微股份	6,249,974.37	0.79

15	000651	格力电器	3,752,505.33	0.47
16	603128	华贸物流	3,672,691.85	0.46
17	600300	人民网	3,157,072.00	0.40
18	601800	中国交建	46,340.00	0.01

注：卖出包括一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		170,159,342.12
卖出股票收入(成交)总额		244,295,863.33

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

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	98,467,150.00	5.21
	其中：政策性金融债	98,467,150.00	5.21

4	企业债券	1,378,876,095.09	73.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	402,449,000.00	21.31
7	可转债	289,648,540.49	15.34
8	其他	-	-
9	合计	1,869,963,635.58	100.00

8.6	合计		2,169,440,785.58	114.88	
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	113001	中行转债	1,750,000	168,612,500.00	8.93

2	1282400	12武汉城投 MTN2	500,000	50,575,000.00	2.68
3	120218	12国开18	500,000	50,020,000.00	2.65
4	1282531	12乌城投 MTN1	500,000	49,990,000.00	2.65
5	1280357	12苏州城投	400,000	40,172,000.00	2.12

1280537	债	400,000	40,172,000.00	2.13
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细				
本基金本报告期末未持有权证。				
8.9 投资组合报告附注				
8.9.1 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				

年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
本基金本报告期末未持有股票。

8.9.3 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	250,000.00

2	应收证券清算款	7,113,031.33
3	应收股利	-
4	应收利息	35,602,156.23
5	应收申购款	57,488,389.85
6	其他应收款	-
9	其他原因	-

	待摊费用			
8	其他			
9	合计			100,453,577.41
8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
				金额单位：人民币元
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

1	113001	中行转债	168,612,500.00	8.93
2	110015	石化转债	30,873,000.00	1.63
3	110003	新钢转债	16,476,800.00	0.87
4	129031	巨轮转债2	12,992,900.49	0.69
5	125089	深机转债	12,803,140.00	0.68

7	113003	重工转债	10,578,000.00	0.56
7	110011	歌华转债	9,271,000.00	0.49
8	110007	博江转债	8,921,700.00	0.47

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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

份额级别	持有人 户数 (人)	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
南方多利	11,028	15,104.13	224,128,028.22	24.67%	681,112,012.95	75.33%

增强债券A	14,808	65,184.19	354,128,605.09	34.62%	631,118,919.96	65.38%
南方多利增强债券C	33,054	24,497.53	168,119,160.13	20.76%	641,622,252.64	79.24%
合计	47,862	37,085.56	502,247,765.22	28.30%	1,272,741,172.60	71.70%

注：分级基金机构个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用该级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即未分级基金份额总额）。均按

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	南方多利增强债券A	0.37	0.00%
	南方多利增强债券C	81,418.21	0.01%
	合计	81,418.58	0.01%

注：1、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，比例的分子采用各自级别的份额，对合计数，比例的分子采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；
2、本公司高级管理人员、基金投资和研究人员未持有本基金份额，本基金基金经理未持有本基金份额。

项目	南方多利增强成分A	南方多利增强成分C
基金转型日(2007年8月28日)基金份额总额	-	507,868,234.72
本报告期初基金份额总额	137,306,903.38	645,993,342.53
本报告期基金总申购份额	2,255,047,950.98	1,959,108,443.43
减:本报告期基金总赎回份额	1,427,107,329.31	1,795,360,373.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-

报告期末基金份额总额	965,247,525.05	809,741,412.77
§ 11 重大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议 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 据公司第五届董事会第二十二次会议审议通过，并经中国证监会证监许可〔2012〕1550号文批准，基金管理人于2012年11月24日发布公告，聘任杨小松为公司督察长。		

根据《公司》第五节聘任董事第二十二次会议审议通过,并向中国基金业协会报备,基金管理人于2013年2月24日发布公告,聘任秦长奎为公司副总经理,同时辞去公司督察长职务。

中国证券投资基金业协会【2013】13号文函复,基金管理人于2013年1月5日发布公告,自2013年1月1日起,良玉不再担任公司总经理职务,由董事长吴万善代为履行公司总经理职务。

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,不涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 6,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年数为 7 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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付给该券商的佣金		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	
银河证券	2	244,295,863.33	100.00%	208,185.20	100.00%	-

2. 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》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。

5. 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. 资讯报告的及时性及便利性。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。

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
招商证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
中信证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
华泰证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
国泰君安	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
海通证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
东方证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
光大证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
广发证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
兴业证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
安信证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
方正证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
国元证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
长江证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
西南证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
国信证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
渤海证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
山西证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
信达证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
浙商证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
东吴证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
恒泰证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
华林证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
国联证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
浙商证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
国联证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
恒泰证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
华林证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
国联证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
恒泰证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
华林证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
国联证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
恒泰证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
华林证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%
国联证券	1,000,000,000.00	100.00%	1,000,000,000.00	100.00%	1,	

银河证券	1,785,541,667.04	100.00%	76,351,068,000.00	100.00%	-	-
------	------------------	---------	-------------------	---------	---	---