# 南方盛元红利混合型证券投资基金

## 【2015】年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司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1月1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 | 南方盛元红利混合 |
| 基金主代码 | 202009 |
| 前端交易代码 | 202009 |
| 后端交易代码 | 202010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年3月21日 |
| 基金管理人 | 南方基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,050,756,121.34份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

注:1、本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方盛元”。

2、本基金合同生效后一年内为封闭式,基金合同生效满一年后转为开放式,本基金已于2009年3月23日转为开放式。

3、本基金已于2015年8月8日转为混合型基金。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为混合型基金,重点投资于具备持续良好盈利和分红能力、分红政策稳定的上市公司,以及高信息披露收益类投资品种。同时积极把握资本利得机会以拓展收益空间,力争为投资者谋求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。 |
| 投资策略 | 本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。 |
| 业绩比较基准 | 90%×上证红利指数+10%×上证国债指数 |
| 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水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 鲍文革 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 010-67596096 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 010-67596096 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 010-66275853 |

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 |

§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 | 2016年 | 2014年 | 2013年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 547,312,624.28 | 363,325,969.43 | 12,150,856.57 |
| 本期利润 | 634,296,197.34 | 378,591,998.59 | 4,823,507.26 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.5603 | 0.2073 | 0.0021 |
| 本期加权平均净值利润率 | 39.60% | 24.17% | 0.27% |
| 本期基金份额净值增长率 | 72.06% | 27.05% | 0.38% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 | 2013年末 |
| 期末可供分配利润 | 482,170,680.32 | -12,777,231.76 | -432,889,031.64 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4589 | -0.0089 | -0.2162 |
| 期末基金资产净值 | 1,762,853,874.09 | 1,428,945,929.62 | 1,669,740,751.60 |
| 期末基金份额净值 | 1.678 | 0.991 | 0.784 |

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

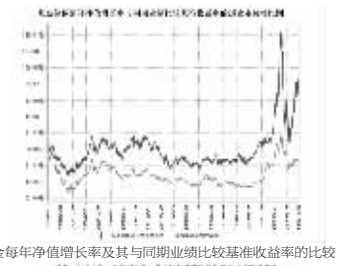
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

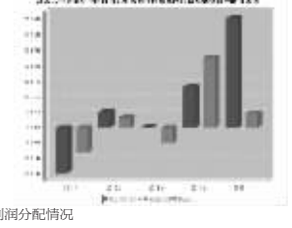
| 3.1.1 期间数据和指标 | | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 51.63% | 2.41% | 13.09% | 1.41% | 38.54% | 1.00% | |
| 过去六个月 | 2.20% | 3.77% | -18.13% | 2.52% | 20.33% | 1.25% | |
| 过去一年 | 72.06% | 3.22% | 9.84% | 2.37% | 62.22% | 0.85% | |
| 过去三年 | 119.45% | 2.12% | 44.20% | 1.69% | 75.25% | 0.43% | |
| 过去五年 | 70.49% | 1.86% | 28.90% | 1.47% | 41.59% | 0.39% | |
| 自基金合同生效起至今 | 88.73% | 1.76% | -13.58% | 1.72% | 102.31% | 0.04% | |

注:本基金的业绩比较基准为90%×上证红利指数+10%×上证国债指数。

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



3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2015 | 0.2000 | 16,521,782.76 | 6,573,725.76 | 23,095,508.51 | |
| 2014 | 0.0500 | 5,342,311.48 | 1,926,638.68 | 7,268,950.16 | |
| 2013 | - | - | - | - | |
| 合计 | 0.2500 | 21,864,094.23 | 8,500,364.44 | 30,364,458.67 | |

§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业务机构。

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 | | |
| 张旭 | 本基金基金经理 | 2012年11月23日 | - | 7年 | 毕业于中央财经大学,获金融学硕士学位,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2008年加入南方基金,曾任金融及地产行业研究员、高级策略研究员、南方盛元基金经理助理;2012年3月至2014年12月,任南方两雅基金经理;2012年11月至今,任南方盛元基金经理;2015年1月至今,任南方产业活力基金经理。 |

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遵规守信情况的说明

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《南方盛元红利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,两两组合间单日、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,并且交易占优比也没有明显异常,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

2015年A股市场走出了波澜壮阔的牛市行情,同时也经历了剧烈波动。全年来看,上证综指上涨9.4%,创业板指数上涨84.4%。从运行节奏看,大致上前两季度迅猛上涨,三季度快速下跌,四季度超跌反弹。资金流与信息流是推动市场走势的重要工具变量,市场比较大的波动与这两种工具的升级密不可分,杠杆资金的大量入市和网络信息的快速传播使市场走势对基本面的反应更为灵敏、更为放大。更为统一协调的金融监管框架对于杠杆资金的规范管理有助于平稳市场。

全面深化改革释放的制度红利,推动中国经济转型升级是造就本轮牛市至关重要的因素。报告期内,基于对A股市场看好的判断,本基金操作上维持了高股票仓位运作。结构上,本基金围绕改革红利的投资主线,自上而下选择受益于改革红利的产业,自下而上优选具有真实成长和远大格局的企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,基金收益率72.06%,业绩基准收益率9.84%。

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年是十三五规划的开局之年,顺利平稳的实现中国经济增速和结构上的换档至关重要,这也是承载中华民族伟大复兴和两个一百年伟大目标的经济基础。

宏观上,中国经济在改革开放以来保持了三十余年的高速增长,创造了举世瞩目的成就,经济增长由高速转为中高速是符合经济发展客观规律的。在深化改革和积极有效的宏观经济政策的推动下,改革红利为中国实体经济和资本市场注入了活力。经济的转型升级为中国经济未来发展指明了方向,也为资本市场酝酿了许多结构性投资机遇。供给侧改革的背景下,货币政策、财政政策以及产业政策走向的变化、对市场的影响值得关注。

微观上,A股市场要走出趋势性长牛行情,上市公司需要在产业结构和产权结构上做出转型升级。目前正在逐步推进的国企改革推动了上市公司产业结构的进一步市场化,微发了企业的效率和活力,越来越多的上市公司通过资本市场的纽带实现的并购重组推动了产业结构的转型升级,从而使A股的基因和微观基础更加优化。中国经济的未来在转型升级,上市公司成长空间也在转型升级,着眼未来,很大程度上市值的再分配是对上市公司参与中国经济转型升级的打分,未来的投资机遇也更多诞生于此。市场内在的规律决定其运行方向不会一蹴而就,在波动中坚定投资理念,防范风险的同时精选优势行业和优质企业来布局,才可为收获打下基础。

伴随中国经济体的壮大和日益全球化,特别是人民币国际化作为大国崛起的重要一环不断取得突破,中国资本市场也必然更多与国际形势联动。在美国加息周期开启的背景下,需更多关注海外局势对国内市场的影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总经理、研究部总监、数量化投资部总监、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,本基金的收益分配原则为:本基金的每份基金份额享有同等分配权;在满足分红条件的前提下,本基金每季度至少分红一次,每年最多分配12次,全年分配比例不得低于年度已实现收益的90%;本基金封闭期内只采取现金分红的方式;封闭期届满后,本基金收益分配方式分为两种: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按除息日的基金份额净值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;封闭期届满后,当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当期收益应先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本基金于2015年3月13日进行了收益分配(每10份基金份额派发红利0.05元);于2015年4月16日进行了收益分配(每10份基金份额派发红利0.05元);于2015年7月17日进行了收益分配(每10份基金份额派发红利0.05元);于2015年10月23日进行了收益分配(每10份基金份额派发红利0.05元);于2016年1月20日进行了收益分配(每10份基金份额派发红利4.47元)。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施的利润分配为23,095,508.51元。

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

本托管人复核审查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。

§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21262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:南方盛元红利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

| 姓名 | 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 | 223,250,925.84 | 119,592,241.48 |
| 结算备付金 | 7,004,704.38 | 4,710,616.66 |
| 存出保证金 | 1,313,196.28 | 595,030.07 |
| 交易性金融资产 | 1,695,996,116.33 | 1,322,507,270.43 |
| 其中:股票投资 | 1,695,996,116.33 | 1,242,803,270.43 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | 79,704,000.00 |
| 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 | - | 3,396,275.69 |
| 应收利息 | 45,978.29 | 1,324,600.03 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 4,018,505.56 | 156,356.16 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,831,629,425.60 | 1,452,272,390.52 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2015年12月31日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 56,879,095.83 | 8,538,474.57 |
| 应付赎回款 | 5,087,964.68 | 8,419,524.24 |
| 应付管理人报酬 | 2,143,863.25 | 2,040,053.29 |
| 应付托管费 | 357,310.56 | 340,008.90 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 4,100,525.17 | 3,674,350.48 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 206,792.03 | 314,049.42 |
| 负债合计 | 68,775,561.51 | 23,326,460.90 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,050,756,121.34 | 1,441,723,161.38 |
| 未分配利润 | 712,097,762.75 | -12,777,231.76 |
| 所有者权益合计 | 1,762,853,874.09 | 1,428,945,929.62 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,831,629,425.60 | 1,452,272,390.52 |

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.678元,基金份额总额1,050,756,121.34份。

7.2 利润表

会计主体:南方盛元红利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1月1日至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 687,621,769.74 | 425,362,613.26 |
| 1.利息收入 | 2,156,008.28 | 4,016,044.86 |
| 其中:存款利息收入 | 890,098.69 | 581,601.00 |
| 债券利息收入 | 1,265,909.59 | 3,065,853.02 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 368,589.84 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 596,044,349.95 | 405,767,026.99 |
| 其中:股票投资收益 | 591,453,179.87 | 397,464,124.38 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 274,600.00 | 555,520.00 |
| 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 | 4,316,570.08 | 7,747,382.61 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”填列) | 86,982,573.06 | 15,266,039.16 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”填列) | 2,438,838.45 | 303,502.25 |
| 减:二、费用 | 53,326,572.40 | 46,760,614.67 |
| 1. 管理人报酬 | 23,819,172.94 | 23,543,490.84 |
| 2. 托管费 | 3,969,862.21 | 3,923,915.27 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 25,113,118.91 | 18,841,706.98 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 424,418.34 | 451,501.58 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 634,295,197.34 | 378,591,998.59 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 634,295,197.34 | 378,591,998.59 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方盛元红利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) | 1,441,723,161.38 | -12,777,231.76 | 1,428,945,929.62 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 634,295,197.34 | 634,295,197.34 |
| 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) | -390,967,040.04 | 113,675,295.68 | -277,291,744.36 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,674,885,345.32 | 1,114,484,769.72 | 2,789,570,115.04 |
| 2.基金赎回款 | -2,065,852,385.36 | -1,001,009,474.04 | -3,066,861,859.40 |
| 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) | - | -23,095,508.51 | -23,095,508.51 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,050,756,121.34 | 712,097,762.75 | 1,762,853,874.09 |
| 项目 | 上年度可比期间 2014年1月1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) | 2,002,629,783.24 | -432,889,031.64 | 1,569,740,751.60 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 378,591,998.59 | 378,591,998.59 |
| 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) | -560,906,621.86 | 48,788,751.45 | -512,117,870.41 |
| 其中:1.基金申购款 | 299,487,600.76 | -8,984,302.72 | 290,503,298.03 |
| 2.基金赎回款 | -860,394,222.62 | 57,773,054.18 | -802,621,168.44 |
| 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) | - | -7,268,950.16 | -7,268,950.16 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,441,723,161.38 | -12,777,231.76 | 1,428,945,929.62 |

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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》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,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 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1月1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 | 657,813,751.86 | 3.97% | 10,439,488.97 | 0.08% |
| 兴业证券 | 1,569,720,427.74 | 9.41% | 2,809,732,372.40 | 22.82% |

7.4.4.1.2 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 | 598,872.11 | 4.01% | - | - |
| 兴业证券 | 1,386,382.85 | 9.28% | 77,562.13 | 1.89% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2014年1月1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 | 9,503.89 | 0.09% | 9,503.89 | 0.26% |
| 兴业证券 | 2,486,337.79 | 22.64% | 669,326.56 | 18.22% |

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1月1日至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 23,819,172.94 | 23,543,490.84 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 4,687,909.67 | 4,587,873.91 |

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1.5%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 1.5% / 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1月1日至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,969,862.21 | 3,923,915.27 |

注:支付基金托管人中国建设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。

7.4.4.2.3 销售服务费

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未发生销售服务费。

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

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

注:本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资。

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

注:本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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1月1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 |
| 中国建设银行 | 223,250,925.84 | 756,987.44 | 119,592,241.48 | 487,175.07 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.5 利润分配情况

7.4.5.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位:人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2015年10月23日 | 2015年10月23日 | 2015年10月23日 | 0.0500 | 3,617,124.50 | 1,645,093.08 | 5,262,217.58 | |
| 2 | 2015年7月17日 | 2015年7月17日 | 2015年7月17日 | 0.0500 | 4,457,333.89 | 1,530,500.79 | 5,987,834.68 | |
| 3 | 2015年4月16日 | 2015年4月16日 | 2015年4月16日 | 0.0500 | 3,924,342.12 | 1,681,453.69 | 5,605,795.81 | |
| 4 | 2015年3月13日 | 2015年3月13日 | 2015年3月13日 | 0.0500 | 4,522,982.24 | 1,716,678.20 | 6,239,660.44 | |
| 合计 | - | - | | 0.2000 | 16,521,782.75 | 6,573,725.76 | 23,095,508.51 | |

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

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000426 | 兴业矿业 | 2015年10月28日 | 重大资产重组 | 7.06 | 2016年3月21日 | 7.77 | 5,000,000 | 33,827,488.53 | 35,300,000.00 | - |
| 002544 | 杰赛科技 | 2015年8月31日 | 重大资产重组 | 41.42 | - | - | 599,999 | 16,976,291.70 | 24,851,958.58 | - |
| 000810 | 创维数字 | 2015年10月22日 | 重大资产重组 | 12.67 | 2016年1月22日 | 12.50 | 1,000,000 | 14,215,217.30 | 12,670,000.00 | - |
| 300069 | 金利华电 | 2015年10月29日 | 重大资产重组 | 29.85 | 2016年2月16日 | 26.87 | 400,000 | 11,602,501.60 | 11,940,000.00 | - |
| 300028 | 金亚科技 | 2015年9月9日 | 重大事项 | 11.42 | - | - | 390,000 | 13,344,126.68 | 4,453,800.00 | - |

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

7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

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 | 1,695,996,116.33 | 87.14 |
| | 其中:股票 | 1,695,996,116.33 | 87.14 |
| 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 | 230,255,630.22 | 12.57 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,377,679.05 | 0.29 |
| 8 | 合计 | 1,831,629,425.60 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.6 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 | 51,990,080.42 | 2.95 |
| C | 制造业 | 935,218,190.96 | 53.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 35,100,234.00 | 1.99 |
| F | 批发和零售业 | 56,359,011.88 | 3.20 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 34,490,329.72 | 1.96 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 183,811,161.98 | 10.43 |
| J | 金融业 | 50,125,727.40 | 2.84 |
| K | 房地产业 | 124,120,631.58 | 7.04 |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,