# 南方稳健成长贰号证券投资基金

## 【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

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。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 南方稳健成长贰号混合 |
| 基金主代码 | 202002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年7月25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 | 3,408,356,689.57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“南稳贰号”。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为稳健成长型基金,在控制投资风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下,力求使该为投资者提供稳健和长期稳定的资本利得。 |
| 投资策略 | 在股票投资方面,本基金根据上市公司的获利能力和成长潜力,主要可以区分为价值型股票和成长型股票,本基金明确界定了价值型和成长型股票的特征,并依据该特征分别构造一个投资组合,本基金投资于这两个组合内股票的比例不低于股票投资部分的80%。 |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为上证综合指数×80%+上证国债指数×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合基金,属证券投资基金中的风险收益适中的品种。 |

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 | 洪渊 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 95588 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 010-66105798 |

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 | 2015年 | 2014年 | 2013年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 1,430,759,829.65 | 526,859,905.24 | 209,667,941.03 |
| 本期利润 | 1,360,619,625.58 | 643,379,404.79 | 187,154,726.97 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3127 | 0.0931 | 0.0236 |
| 本期基金份额净值增长率 | 42.42% | 21.48% | 5.13% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 | 2013年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2808 | 0.0217 | -0.0601 |
| 期末基金资产净值 | 2,635,579,440.02 | 3,417,730,051.80 | 3,450,620,064.77 |
| 期末基金份额净值 | 0.7733 | 0.5622 | 0.4628 |

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。

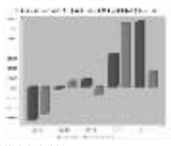
3.2 基金净值表现

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

| 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 | 27.23% | 1.57% | 13.12% | 1.26% | 14.11% | 0.31% |
| 过去六个月 | 0.01% | 2.60% | -12.90% | 2.09% | 12.91% | 0.51% |
| 过去一年 | 42.42% | 2.32% | 10.04% | 1.96% | 32.38% | 0.36% |
| 过去三年 | 81.89% | 1.58% | 48.93% | 1.35% | 32.96% | 0.23% |
| 过去五年 | 42.54% | 1.35% | 28.05% | 1.19% | 14.49% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 177.98% | 1.46% | 106.19% | 1.44% | 71.79% | 0.02% |

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 | 52,161,072.49 | 66,811,295.38 | 118,972,367.87 | |
| 2014 | - | - | - | - | |
| 2013 | - | - | - | - | |
| 合计 | 0.2000 | 52,161,072.49 | 66,811,295.38 | 118,972,367.87 | |

§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 | | |
| 应帅 | 本基金基金经理 | 2012年11月23日 | - | 14年 | 北大光华管理学院管理学硕士,具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员,2007年加入南方基金,2007年5月至2009年2月,任南方宝元基金经理;2007年5月至2012年11月,任南方成份基金经理;2010年12月至今,任南方宝元基金经理;2012年11月至今,任南方稳健基金经理;2012年11月至今,任南稳贰号基金经理。 |
| 李源海 | 本基金基金经理 | 2010年7月15日 | 2015年2月16日 | 14年 | 管理学博士,具有基金从业资格。曾任职于中国银行深圳分行、湘财证券有限责任公司投资银行部及证券投资部;2002年起进入基金行业,历任万家基金管理有限公司(原天同基金管理有限公司)研究部高级经理、基金管理部基金经理;2004年9月至2005年10月任万家增强收益债券型证券投资基金(原天同保本增值证券投资基金)基金经理;2006年7月至2007年7月任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理;2006年2月至2009年8月,任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理;2008年7月至2009年8月,任申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金经理。2009年8月,加入南方基金,任职于产品开发部;2010年1月至2015年2月,担任南方基金投资部副总监、南方配置基金经理;2010年7月至2015年2月,任南方稳健、南稳贰号基金经理。 |
| 蔡望鹏 | 本基金基金经理助理 | 2013年6月20日 | 2015年1月13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,任南方科技基金经理;2015年7月至今,任南方中国梦基金经理。 |
| 方健 | 本基金基金经理助理 | 2015年3月25日 | 2015年5月26日 | 3年 | 清华大学材料科学与工程专业博士,具有基金从业资格。2012年7月加入南方基金,任研究部助理研究员,负责中小市值的行业研究;2015年2月至5月,担任南方盛元、南方产业活力基金经理助理。2015年3月至5月,担任南方稳健、南稳贰号、南方宝元基金经理助理。 |

注:1. 对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、2015年2月17日,公司发布变更基金经理的公告,解除李源海本基金经理职务。

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《南方稳健成长贰号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年中国股票市场波荡起伏,上半年在资金牛、改革牛以及互联网+的推动下,A股市场迎来了巨大的涨幅,沪深300最大上涨幅度超过50%,创业板指数最大上涨幅度超过170%。然而6月下旬以来中国股票市场出现了前所未有的挑战,持续大幅震荡下跌到接近8月底,沪深300和创业板跌幅都超过40%。本基金年初以来对资本市场比较乐观,仓位一直高居不下,在上半年获得了较好的收益,但随之而来的市场调整让基金净值遭受较大损失。本基金上半年主要配置在计算机、传媒等新兴产业以及电力、机械等传统行业,在三季度市场调整过程中,大幅度降低了计算机板块的配置,同时加大了新能源汽车、转型股、地产股的配置,在年底的反弹中基金也获得了较好的投资收益。本基金将继续采取自下而上的选股策略,同时将更加注重择时策略,争取获得较好的绝对收益和相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年沪深300指数增长率为5.58%,基金净值增长率为42.42%,业绩基准为10.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年GDP增速与过往相比尽管有所降低,但仍处于较高水平。展望2016年,随着国企改革的深入、货币政策和财政政策的适度宽松,经济增速预计仍可维持较好水平。由于全球经济局势有所反复以及人民币汇率波动调整,预计中国A股市场会震荡加剧。

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: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,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的90%,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按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本基金于2016年1月20日进行本基金的2015年年度收益分配(每10份基金份额派发红利2.53元);本报告期内2015年1月19日已分配数(每10份基金份额派发红利0.20元)为以往年度收益分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对南方稳健成长贰号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,南方稳健成长贰号证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方稳健成长贰号证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,南方稳健成长贰号证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额118,972,367.87。

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稳健成长贰号证券投资基金2014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21263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:南方稳健成长贰号证券投资基金

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 | 64,525,189.84 | 105,730,461.18 |
| 结算备付金 | 9,999,296.74 | 9,957,350.52 |
| 存出保证金 | 1,823,964.13 | 1,177,298.77 |
| 交易性金融资产 | 2,566,515,547.84 | 3,343,119,380.79 |
| 其中:股票投资 | 1,991,796,894.04 | 2,612,110,225.79 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 574,718,653.80 | 731,009,155.00 |
| 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 | 39,041,309.80 | 616,939.06 |
| 应收利息 | 13,080,373.16 | 13,398,615.25 |
| 应收股利 | 20,000.00 | 20,000.00 |
| 应收申购款 | 537,285.12 | 3,014,306.61 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,695,542,956.63 | 3,477,034,352.18 |
| 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 | 48,142,740.66 | 37,826,877.48 |
| 应付赎回款 | 2,943,385.11 | 10,783,915.67 |
| 应付管理人报酬 | 3,306,332.89 | 4,432,788.23 |
| 应付托管费 | 550,888.80 | 738,798.02 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 4,917,076.26 | 5,165,778.93 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 104,092.89 | 356,142.05 |
| 负债合计 | 59,963,516.61 | 59,304,300.38 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,603,694,519.46 | 2,860,501,113.39 |
| 未分配利润 | 1,031,884,920.56 | 557,228,938.41 |
| 所有者权益合计 | 2,635,579,440.02 | 3,417,730,051.80 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,695,542,956.63 | 3,477,034,352.18 |

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.7733元,基金份额总额3,408,356,689.57份。

7.2 利润表

会计主体:南方稳健成长贰号证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 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 | 1,456,452,107.16 | 726,506,899.75 |
| 1.利息收入 | 29,105,783.57 | 28,642,540.71 |
| 其中:存款利息收入 | 1,151,621.70 | 1,222,506.90 |
| 债券利息收入 | 27,713,537.60 | 26,833,471.85 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 240,624.27 | 586,561.96 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 1,494,370,410.89 | 580,421,027.93 |
| 其中:股票投资收益 | 1,478,277,182.39 | 557,968,001.24 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 3,292,147.75 | -9,940,018.29 |
| 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 | 12,801,080.75 | 32,393,044.98 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -70,140,204.07 | 116,519,499.55 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 3,116,116.77 | 923,831.56 |
| 减:二、费用 | 96,832,481.58 | 83,127,494.96 |
| 1. 管理人报酬 | 45,203,238.14 | 49,191,182.14 |
| 2. 托管费 | 7,533,872.96 | 8,198,530.25 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 42,658,792.34 | 24,818,053.02 |
| 5. 利息支出 | 45,625.43 | 481,105.70 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 45,625.43 | 481,105.70 |
| 6. 其他费用 | 390,952.71 | 438,623.85 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 1,360,619,625.58 | 643,379,404.79 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 1,360,619,625.58 | 643,379,404.79 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方稳健成长贰号证券投资基金

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) | 2,860,501,113.39 | 557,228,938.41 | 3,417,730,051.80 |
| 二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 1,360,619,625.58 | 1,360,619,625.58 |
| 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) | -1,256,806,593.93 | -766,991,275.56 | -2,023,797,869.49 |
| 其中:1.基金申购款 | 303,602,446.15 | 165,334,946.66 | 468,937,392.81 |
| 2.基金赎回款 | -1,560,409,040.08 | -932,326,222.22 | -2,492,735,262.30 |
| 四.本期向持有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) | - | -118,972,367.87 | -118,972,367.87 |
| 五.期末所有者权益(基金净值) | 1,603,694,519.46 | 1,031,884,920.56 | 2,635,579,440.02 |
| 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) | 3,508,495,569.98 | -57,875,505.21 | 3,450,620,064.77 |
| 二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 643,379,404.79 | 643,379,404.79 |
| 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) | -647,994,456.59 | -28,274,961.17 | -676,269,417.76 |
| 其中:1.基金申购款 | 59,113,604.57 | 3,608,977.00 | 62,722,581.57 |
| 2.基金赎回款 | -707,108,061.16 | -31,883,938.17 | -738,991,999.33 |
| 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) | 2,860,501,113.39 | 557,228,938.41 | 3,417,730,051.80 |

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 | 272,016,846.62 | 0.98% | 212,327,076.91 | 1.31% |
| 兴业证券 | 600,627,089.93 | 2.17% | 335,518,746.33 | 2.08% |

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。

7.4.2.1.3 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 | 240,708.16 | 0.97% | - | - |
| 兴业证券 | 535,066.20 | 2.15% | 123,240.33 | 2.51% |
| 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 | 187,888.73 | 1.30% | - | - |
| 兴业证券 | 296,901.41 | 2.05% | - | - |

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 | 45,203,238.14 | 49,191,182.14 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 5,709,868.49 | 6,174,601.60 |

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X1.50%/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 | 7,533,872.96 | 8,198,530.25 |

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X0.25%/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

单位:人民币元

| 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | 50,268,797.26 | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | 57,513,784.11 | - | - | - | - | - |

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:本基金本的基金管理人于报告期内及上年度可比期间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:于本报告期末及上年度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 |
| 中国工商银行 | 64,525,189.84 | 944,962.74 | 105,730,461.18 | 1,106,520.83 |

注:本基金的活期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

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及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.5 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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29日 | 重要事项 | 65.01 | 2016年1月4日 | 63.90 | 399,958 | 26,820,534.06 | 26,001,269.58 | - |
| 300038 | 梅泰诺 | 2015年12月15日 | 重大资产重组 | 56.68 | - | - | 580,989 | 23,235,736.14 | 32,930,456.52 | - |
| 600354 | 敦煌种业 | 2015年12月14日 | 重大资产重组 | 9.88 | 2016年1月19日 | 8.89 | 599,814 | 8,649,796.30 | 5,926,162.32 | - |
| 600153 | 建发股份 | 2015年6月26日 | 重大资产重组 | 14.69 | - | - | 61 | 907.06 | 896.09 | - |
| 300028 | 金亚科技 | 2015年6月9日 | 重大事项 | 11.42 | - | - | 16 | 531.47 | 182.72 | - |
| 002053 | 云南盐化 | 2015年11月18日 | 重大资产重组 | 25.84 | 2016年3月14日 | 23.26 | 1 | 23.89 | 25.84 | - |

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。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末及上年度可比期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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 | 1,991,796,894.04 | 73.89 |
| | 其中:股票 | 1,991,796,894.04 | 73.89 |
| 2 | 固定收益投资 | 574,718,653.80 | 21.32 |
| | 其中:债券 | 574,718,653.80 | 21.32 |
| | 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 | 74,524,476.58 | 2.76 |
| 7 | 其他各项资产 | 54,502,932.21 | 2.02 |
| 8 | 合计 | 2,695,542,956.63 | 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 | 5,926,162.32 | 0.22 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,283,907,863.96 | 48.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 32,325,000.00 | 1.23 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 126,779,477.42 | 4.81 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 2,122.19 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 94,526,596.90 | 3.59 |
| J | 金融业 | 199,559,456.57 | 7.57 |
| K | 房地产业 | 198,492,890.70 | 7.53 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 26,001,289.58 | 0.99 |
| 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 | 24,276,054.50 | 