

(上接B314版)

交易费用的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围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投资服务等。

关联方报账
基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	2015年12月31日基金合同生效日至2015年12月31日
当期发生的基金支付的客户交易费	12,722,500.47	
其中:支付给基金管理人的客户交易费	1,514,760.08	

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬前一日基金资产净值1.6%的年费率计算,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=前一天基金资产净值 × 1.6% /当年天数。

基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	2015年12月31日基金合同生效日至2015年12月31日
当期发生的基金支付的客户交易费	12,722,500.47	
其中:支付给基金管理人的客户交易费	1,514,760.08	

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬前一日基金资产净值1.6%的年费率计算,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=前一天基金资产净值 × 1.6% /当年天数。

基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	2015年12月31日基金合同生效日至2015年12月31日
当期发生的基金支付的客户交易费	12,722,500.47	
其中:支付给基金管理人的客户交易费	1,514,760.08	

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬前一日基金资产净值0.3%的年费率计算,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一天基金资产净值 × 0.3% /当年天数。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

各关联方投资本基金的情况

报告期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	2015年12月31日基金合同生效日至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年5月13日)持有的基金	96,156,433.48	

报告期内未发生与关联方的定期交易

与关联方进行定期交易的金额

减:期末持有的基金份额

期末持有的基金份额

注:基金管理人南方基金管理有限公司在本会计期间赎回回本基金的交易委托华泰证券办理,适用费率0.00%。

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。

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12月31日基金合同生效日至2015年12月31日
中国银行	4,399,631.96	209,522.27

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人组织均购银行保管,适用利率为定期利率。

本基金在承销期内参与与关联方承销证券的情况

无。

其他关联交易事项的说明

无。

利润分配情况

无。

期末持有的基金份额

注:本基金的基金资产部分由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人组织均购银行保管,适用利率为定期利率。

本基金在承销期内参与与关联方承销证券的情况

无。

与关联方进行定期交易的说明

无。

利润分配情况

无。

期末持有的基金份额

注:本基金截至2015年12月31日止持有以上公布的的重大事项可能产生重大影响的被暂停停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所以复牌时算。

2. 未估价单位采用2015年12月31日期权汇率将港币折算为人民币,复牌开盘价采用复牌日的即期汇率将港币折算为人民币,复牌开盘价采用复牌日的即期汇率将港币折算为人民币。

§ 9 资产组合报告(转型前)

报告期(2015年1月1日 - 2015年5月12日)

1.1 基金期末资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权证投资	2,661,029,380.03	63.02
2	货币市场基金	2,661,029,380.03	63.02
3	其他投资	2,661,029,380.03	63.02
4	银行存款	4,399,631.96	0.00
5	其他资产	67,718,367.07	0.00
6	应收利息	2,661,029,380.03	63.02
7	银行存款和结算备付金合计	300,100,000.00	1.00
8	应收利息	69,443,479.00	0.20
9	合计	3,062,389,140.00	100.00

注:比例由单项和汇总原因,可能存在尾差。

1.2 每月末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	2,661,029,380.03	63.02
合计	2,661,029,380.03	63.02

1.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
非金融类消费品	6,761.76	0.00
金融类消费品	2,524.52	0.00
能源	4,737.83	0.00
原材料	1,000	0.00
工业	440,536,676.30	100.00
材料	776,110,703.03	6.30
公用事业	441,307,419.08	9.63
合计	2,561,399,277.07	100.00

注:1.以上行业分类采用彭博行业分类标准。

2.比例由于单项和汇总原因,可能存在尾差。

1.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
非金融类消费品	6,761.76	0.00
金融类消费品	2,524.52	0.00
能源	4,737.83	0.00
原材料	1,000	0.00
工业	440,536,676.30	100.00
材料	776,110,703.03	6.30
公用事业	441,307,419.08	9.63
合计	2,561,399,277.07	100.00

注:1.以上行业分类采用彭博行业分类标准。

2.比例由于单项和汇总原因,可能存在尾差。

1.4 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益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在国家(地区)	类别(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Bridgestone America Holdings Limited	固特异轮胎橡胶(中国)有限公司	1114.HK	香港交易所	中国	4,860,000,000	63.29
2	China Everbright Holdings Limited	中国光大国际有限公司	267.HK	香港交易所	中国	3,969,000,000	5.17
3	Fosun International Limited	复星国际有限公司	696.HK	香港交易所	中国	2,816,500,000	3.67
4	HNIN Energy Holdings Limited	新奥能源控股有限公司	2029.HK	香港交易所	中国	1,000,000,000	1.31
5	Winton Group Limited	威腾集团有限公司	3393.HK	香港交易所	中国	1,000,000,000	1.31

注:1.本基金管理人以上证券代码采用当地市场代码。

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

1.4.2 购买投资组合按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在国家(地区)	类别(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)

<tbl_r cells="8" ix="2" maxcspan="1" maxr