

[illegible]

基金组合投资报告截至日期2014年12月31日。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元			
序号	投资组合	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	52,927,157.04	6.24
2	债券投资	12,097,157.04	0.24
3	货币市场工具	4,922,260,161.89	97.25
4	资产支持证券	4,972,260,353.29	97.23
5	银行存款和结算备付金合计	10,000,000.00	0.20
6	其他金融资产	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他投资	-	-
9	资产支持证券的公允价值变动资产	-	-
10	待摊费用	13,999,729.28	0.03
11	递延所得税资产	130,523,751.74	2.14
12	其他资产	5,171,095,524.58	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元			
行业	公允价值(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 医药、生物、化学	-	-	-
B 信息技术	-	-	-
C 金融、地产	12,097,157.04	-	0.24
D 电力、燃气、水务及生产服务业	-	-	-
E 煤炭采选	-	-	-
F 农林牧渔	-	-	-
G 交通运输、仓储和快递	80,124,000.00	-	20.61
H 公用事业	-	-	-
I 制造业-软件和信息技术服务业	90,150,000.00	-	22.57
J 其他行业	1,654,774,751.30	-	41.58
K 未分类资产	1,654,000,000.00	-	40.80
L 其他资产	30,914,000.00	-	0.77
M 合计	267,367,928.22	-	6.67
N 其他	-	-	-
O 货币市场工具	-	-	-
P 银行存款和结算备付金	-	-	-
Q 待摊费用	-	-	-
R 其他资产	-	-	-
S 公允价值变动资产	-	-	-
T 其他	-	-	-
U 合计	12,097,157.04	-	0.24

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002034	九鼎投资	80,400	12,097,157.04	0.24

4、报告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	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	10,000,000.00	0.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,150,000.00	2.14
4	企业债、中期票据	80,124,000.00	1.96
5	地方政府债	1,654,774,751.30	41.58
6	公司债	1,654,000,000.00	40.80
7	资产支持证券	30,914,000.00	0.77
8	其他	-	-
9	合计	4,727,260,161.89	119.61

5、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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140009	14国债09	2,000,000	20,970,000.00	3.21
2	130013	13国债01	1,200,000	14,190,000.00	2.23
3	681030Z	14国债Z030	3,000,000	30,150,000.00	3.62
4	140002	14国债02	3,000,000	39,410,000.00	3.62
5	140005	14国债05	1,300,000	15,410,000.00	1.38

6、报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	115109	国开1109	90,000	5,000,000.00	0.12
2	115111	国开1111	90,000	5,000,000.00	0.12

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持权证。

8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.2 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范围。

8.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额(元)
1	应收利息	130,523,751.74
2	应收股利	-
3	应收申购款	17,579,877.22
4	应收权证	-
5	其他应收款	85,767,407.11
6	其他资产	124,679,800.00
7	待摊费用	13,999,729.28
8	其他	-
9	合计	181,927,297.74

8.4 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	11国债05	61,294,000.00	2.89
2	110010	11国债10	55,840,000.00	1.31
3	120049	12国债09	47,826,211.11	1.12
4	110022	11国债02	13,627,000.00	0.63
5	120012	12国债01	12,500,000.00	0.31
6	120006	12国债06	10,177,000.00	0.25
7	120014	12国债14	26,840.00	0.00

8.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

十二、基金的投资

基金管理人恪尽职守、诚信尽责,勤勉尽责的开展管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来业绩,投资有风险,投资者在做出投资决策前,应仔细阅读基金的招募说明书。

南方多利A

报告期	报告期末基金资产净值	报告期末基金份额总额	本报告期基金份额净值增长率	本报告期基金份额净值增长率标准差	本报告期基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的差额	本报告期基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的差额标准差
2013.1.1-2013.12.31	4,405.11	10,286.22	10.28%	0.60%	0.00%	0.28%
2013.1.1-2013.12.31	4,405.11	10,286.22	-0.40%	-0.20%	-0.40%	0.10%
2013.1.1-2013.12.31	4,405.11	10,286.22	-0.40%	-0.20%	-0.40%	0.10%
2013.1.1-2013.12.31	4,405.11	10,286.22				