

(上接B035版)

本投资组合报告所载数据截至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	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	12,097,157.04	0.24
其中：股票		12,097,157.04	0.24
2	固定收益投资	4,982,283,934.59	97.37
其中：债券		4,972,853,934.59	97.17
货币市场工具		10,000,000.00	0.20
3	贵金属投资	—	—
4	衍生工具投资	—	—
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	11,989,579.25	0.23
7	其他资产	110,363,757.74	2.16
8	合计	5,147,093,589.62	100.00

2、报告期末按照行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	12,097,157.04	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	12,097,157.04	0.29

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	002318	立讯精密	40,858	12,097,157.04	0.29

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	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	162,068,000.00	3.90
2	央行票据	—	—
3	企业债券	901,004,000.00	21.67
其中：可转换企业债		901,004,000.00	21.67
4	金融债券	1,054,773,871.30	25.37
5	企业短期融资券	1,634,859,000.00	39.80
6	中期票据	839,193,000.00	20.18
7	司债券	369,367,064.29	8.67
8	其他	—	—
9	合计	4,972,283,934.59	119.99

5、报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140358	14农发08	2,100,000	216,993,000.00	5.22
2	110015	石化转债	1,200,000	161,904,000.00	3.89
3	041453021	14国电EB001	1,500,000	150,960,000.00	3.63
4	140907	14八连债	1,500,000	150,435,000.00	3.62
5	140301	14农发01	1,300,000	136,318,000.00	3.28

6、报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119169	渤海信托-渤海信托01	50,000	5,000,000.00	0.12
2	119111	渤海信托-渤海信托03	30,000	3,000,000.00	0.12

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金报告期内未持有权证。

8、投资组合报告附注

8.1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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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库。

8.3期间其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	卖出回购证券	199,073.37
2	应收证券清算款	11,769,987.27
3	应收股利	—
4	应收利息	85,740,771.71
5	应付申购款	12,657,799.39
6	预提费用	114,300.00
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	110,780,757.74

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	140301	石化转债	161,904,000.00	3.89
2	110020	南山转债	55,844,000.00	1.34
3	125609	深机转债	47,196,764.11	1.13
4	110123	民生转债	13,827,000.00	0.33
5	110112	南航转债	12,901,000.00	0.31
6	126066	长青转债	10,477,000.00	0.25
7	110202	国电转债	25,484,000.00	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、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的历史过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

南方多利A

阶段	份额净值增长率①	份额净值②	份额净值增长率③	业绩比较基准收益率④	业绩比较基准收益率标准差⑤	①-③	②-④
2009.9.23-2009.12.31	4.66%	0.32%	-0.28%	0.04%	4.94%	0.28%	
2010.1.1-2010.12.31	4.43%	0.29%	-0.17%	0.10%	5.32%	-0.18%	
2011.1.1-2011.12.31	-0.48%	0.34%	2.32%	0.11%	-3.00%	0.22%	
2012.1.1-2012.12.31	11.39%	0.19%	-0.67%	0.07%	12.06%	-0.12%	
2013.1.1-2013.12.31	-0.47%	0.14%	-2.28%	0.11%	4.81%	0.03%	
2014.1.1-2014.12.31	15.64%	0.16%	7.48%	0.15%	8.16%	0.01%	
自基金合同生效至今	39.50%	0.23%	2.47%	0.11%	37.03%	0.12%	

南方多利C

阶段	净值增长率①	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
2007.8.26-2007.12.31	7.04%	0.20%	-1.22%	0.11%	8.26%	0.14%
2008.1.1-2008.12.31	3.37%	0.20%	11.01%	0.21%	-7.64%	-0.01%
2009.1.1-2009.12.31	3.42%	0.27%	-4.44%	0.11%	7.86%	0.16%
2010.1.1-2010.12.31	4.11%	0.20%	-0.87%	0.10%	4.98%	0.13%
2011.1.1-2011.12.31	-0.78%	0.34%	2.32%	0.11%	-3.30%	0.23%
2012.1.1-2012.12.31	11.06%	0.19%	-0.67%	0.07%	11.73%	0.12%
2013.1.1-2013.12.31	-0.76%	0.14%	-2.28%	0.11%	4.32%	0.03%
2014.1.1-2014.12.31	15.28%	0.16%	7.48%	0.15%	7.80%	0.01%
自基金合同生效至今	50.19%	0.23%	7.68%	0.13%	42.51%	0.10%

十三、基金费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1.与基金运作相关的费用种类:

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)持续销售费;

(4)证券交易所费用;

(5)银行划拨费用;

(6)基金信息披露费用;

(7)基金持有人大会费用;

(8)与基金相关的会计师费和律师费;

(9)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2.与基金运作有关费用计提方法、计价标准和支付方式

(1)基金管理费

在通常情况下,本基金的管理费按前一日基金资产净值0.6%的年费率计算,计算方法如下:

$H = E \times 0.6\% \quad \text{当年天数}$

H为每日计划提取的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提,按月支付,由基金管理人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(3)上述“1.与基金运作有关费用的种类”中(4)到(9)项费用由基金管理人根据其它有关规定和相应协议的规定,按实际用款金额支付,列入当期基金费用。

(4)与基金销售有关的费用

1.申购费

本基金C类基金份额的申购费率为零,但从本类别基金资产中计提持续销售费;A类基金份额领取申购费但不从本类别基金资产中计提持续销售费。

本基金申购费率为:

A类基金份额申购费如下:

费率种类	A类基金份额	C类基金份额
购买金额(M)	前端申购费率	
M<100万	0.80%	
100万≤M<500万	0.50%	0
500万≤M<1000万	0.10%	
M≥1000万	每笔1000元	

2.赎回费

本基金赎回费率最高不超过0.1%。持有期限在30日以内的基金份额,赎回费率为0.1%;持有期限超过30日(含30日)的基金份额,不收取赎回费用。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中不低于25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3.持续销售费

持续销售费主要用以支付销售机构佣金,以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

H= B × 0.2% + 年当年天数

H为每日计划提取的持续销售费

E为前一日基金资产净值

基金管理人向基金托管人发送持续销售费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(4)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)基金管理人和基金托管人因未履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3.《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师费、律师费、信息披露费用等;

4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率或持续销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基本托管费率或持续销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会;

降低基金管理费率、基本托管费率或持续销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会;

调低基金管理费率、基本托管费率或持续销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会;

增加基金管理费率、基本托管费率或持续销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会;

减少基金管理费率、基本托管费率或持续销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会;

修改基金合同条款,须召开基金份额持有人大会;

修改基金合同的其他条款,须召开基金份额持有人大会;

修改基金合同的其他条款,须