

海通证券	-	-	70,000,000.00	10.89%	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

南方达基金管理有限公司
二〇一六年三月二十五日

6	企业短期融资券	-	-	-
7	中期票据	-	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-	-
8	固定存单	-	-	-
9	其他	-	-	-
10	合计	346,446,500.00	-	4.25

R.6 期末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

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	占基金资产净值比例(%)
1	150311	15债011	2,000,000	200,200,000.00	2.44

2	150416	15次发行	800,000	80,184,000.00	0.981
3	150413	15次发行	500,000	50,065,000.00	0.601
	0101001	国开13债	150,000,000	15,051,500,000.00	0.18

K.7 期末公允价值占基金资产净值比例前十大持仓的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

K.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例前十大持仓的资产支持证券属违约或暂停兑付状态的资产支持证券

本基金报告期末未持有资产支持证券。

K.9 报告期末公允价值占基金资产净值比例前十大持仓的资产证券化交易投资明细

本基金报告期末未持有资产证券化。

K.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期末未持有股指期货。

8.1.1 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债逆回购。

8.1.2 投资组合报告期末前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
8.1.2.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
8.1.2.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库。

8.1.2.3 报告期末其他资产构成

			单位:人民币元
序号	名称	金额	
1	存出保证金	5,201,154.09	
2	应收利息/股利	293,140.00	

3	应收股利		
4	应收利息	6,011,146.05	
6	应收中票款	2,302,012.31	
6	其他应收款		
7	待摊费用		
8	其他		
9	合计	14,208,634.21	

R12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券的期末基金本金余额未持有处于转股期的可转换债券。

R12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构					份额单位:份	
序号	股票代码	股票名称	流通受限股份的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明	
1	300010	立讯精密	319,113,074.10	3.90	重大人事停牌	
2	600271	航天信息	300,132,000.00	3.69	重大人事停牌	
3	600699	伟创电子	140,142,004.65	1.71	重大人事停牌	
4	002312	三泰控股	84,496,400.00	1.03	非公开发行流通受限	

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构					份额单位:份	
持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构				
		机构投资者		个人投资者		
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	

9.2	期是基金管理人的从业人员持有本基金的情况	240,060 10,204,321	162,383,112,019	4.32%	3,562,362,060,000	90.68%
	基金管理人所有从业人员持有本基金情况			持有的基金份额总数(份)	占基金总份额比例	
				50,104,032	0.00161%	
9.3	期末基金投资管理人的从业人员持有本公司开放式基金份额区间的情况					
项目	持有基金份额总额的数量区间(万份)					
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员 自前月末持有本公司开放式基金	0-10					
本公司基金基金经理持有本公司开放式基金	0-10					
§ 10 开放式基金申购赎回						
单位:份						
基金合同生效日2007年9月21日基金总份额总额						
10,874,529,465.41						

本报告期末基金份额总额	6,631,339,462.25
本报告期末基金份额持有人户数	1,498,819,173.13
户：本报告期末基金总份额占户均	6,536,131.13
本报告期末基金份额变动总额	-
本报告期末基金份额持有人户数	3,764,706,183.13

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议
 本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
 2016年6月24日，本基金管理人完成公司法规定要求的大股东的工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘国祥。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
 本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资顾问协议的情况
本报告期内本基金投资顾问未有重大变化。

11.5 为报告期内审计的会计师事务所情况
本基金自基金合同生效以来就持续在聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为130,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查处罚等情况
本报告报告期内基金管理人及托管人(托管业务部)及高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易席位的情况
11.7.1 基金租用证券公司交易席位用于股票投资及债券支付情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		应付证券清算的资金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总额的比例	
招商证券	2	2,346,488,365.82	4.14%	2,960,799.38	4.52%	--
中信公司	2	1,696,361,169.00	2.25%	1,564,900.91	2.39%	--
华泰证券	1	1,023,154,031.07	2.76%	1,790,220.72	2.76%	--
华创证券	1	5,561,546,626.81	7.47%	4,041,556.55	6.76%	--
国泰君安	1	--	--	--	--	--

恒安证券	4,235,000,000.00	3.82%	3,820,000,000.00	0.03%
国元证券	18,399,029,124.21	0.02%	17,135,133.33	0.03%
中国建投	1,327,463,799.30	0.01%	1,131,926.42	0.26%
中国建投	2,779,980,906.93	5.13%	3,463,330.03	6.24%
瑞信证券	1,369,101,703.99	1.1%	2,798,276.23	0.49%
招商证券	483,040,287.87	0.04%	468,397.21	0.04%
东方证券	1,028,101,021.33	1.39%	161,183.44	1.96%
东方证券	1,181,382,539.20	0.26%	100,160.62	0.22%
东方证券	1,509,268,984.51	8.06%	5,462,711.76	8.41%
安信证券	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-
国金证券	2,640,786,020.28	8.69%	5,184,004.46	7.96%
兴业证券	2,510,549,409.62	4.70%	3,194,001.41	2.50%

民生证券	1	5,273,490,144.00	7.16%	4,827,417,285	7.41%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	2,428,936,271.93	3.39%	2,211,303,29	3.39%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
中国证券	2	2,488,022,972.17	3.38%	2,265,264,659	3.48%	-
光大证券	1	1,069,752,286.08	1.45%	856,301,204	1.31%	-
中国银河	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	466,577,103.22	0.62%	419,579.93	0.04%	-
广州证券	2	2,438,438,203.73	3.31%	2,018,830.91	3.10%	-
华泰证券	1	4,222,688,087.46	6.73%	3,886,416.49	6.02%	-

大阳证券	6984	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
广发证券	2	6,233,673,443.37	1.23%	4,188,040,647	0.62%
海通证券	2	6,769,488,577.30	7.82%	5,200,226,226	8.12%
财信证券	1	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-

(注: A 股报告期内本基金减持海通证券股份有限公司一个交易单元, 增持华西证券股份有限公司一个交易单元, 并暂停证券账户更名为华泰证券股份有限公司。宏源证券股份有限公司现已更名为华泰证券股份有限公司。

3、本基金管理人负责选择证券经纪商, 按照以下交易单元为基金的基本交易单元。基金交易单元的选择标准如下:

- 1) 具有合法的经营资格, 财务状况良好, 诚信记录良好, 具备开展基金交易的条件;
- 2) 具备基金业务所需的有效、安全的通讯系统, 交易设施完整并具备进行证券交易的能力;
- 3) 具有较好的研究能力和水平, 包括但不限于: 较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量信息资料, 能够对证券价格做出独立的判断, 并提供有价值的投资建议, 具有独立的、高质量的研究服务能力;

本基金为主动管理型基金，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期增值。本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

（5）基金管理人根据下列原则进行资产配置：

- 1）本基金管理人根据上述标准原则确定采用交易型证券投资策略。
- 2）基金管理人根据上述证券投资策略和持仓比例进行资产配置。

11.7.2 基金运用证券交易代理进行其他证券投资的投资决策

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交金额的 比例	成交金额	占当期债券回 购成交金额的 比例	成交金额	占当期权证比 成交金额的比例
招商证券	0.00	0.0000	2.37	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	—	—	—	—

鹏华证券	--	--	--	--	--
华鑫证券	--	--	--	--	--
国泰创投	--	--	--	--	--
中信证券	46,269,320.00	18.12%	44,000,000.00	12.50%	--
华安证券	--	--	--	--	--
国信证券	--	--	--	--	--
中信建投	--	--	--	--	--
国联证券	4,001,790.62	1.67%	--	--	--
新时代证券	--	--	--	--	--
东吴证券	--	--	--	--	--
渤海证券	--	--	--	--	--
东方证券	--	--	--	--	--

安信证券	--	--	--	--	--	--
西南证券	--	--	--	--	--	--
国信证券	--	--	--	--	--	--
兴业证券	--	--	--	--	--	--
民生证券	104,741,202.00	41.02%	163,100,000.00	46.34%	--	--
华安证券	--	--	--	--	--	--
山西证券	--	--	--	--	--	--
华泰证券	--	--	--	--	--	--
中投证券	16,488,733.62	6.46%	--	--	--	--
江南证券	--	--	--	--	--	--
中银证券	--	--	--	--	--	--
资本证券	77,706,800.82	30.44%	--	--	--	--

中国银河	--	--	--	--	--
东北证券	--	--	--	--	--
广州证券	--	--	--	--	--
华创证券	--	--	74,000,000.00	21.28%	--
方正证券	--	--	--	--	--
天源证券	--	--	--	--	--
广发证券	--	--	--	--	--
海通证券	--	--	70,000,000.00	19.89%	--
财信证券	--	--	--	--	--
国金证券	--	--	--	--	--
申万宏源	--	--	--	--	--

易方达基金管理有限公司
二〇一六年三月二十五日