中国梦灵活配置混合型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31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
送出日期:2015年3月26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2015年3月20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2014年6月9日(基金合同生效日)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	中国梦灵活配置混合
基金主代码	000554
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月9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	281,369,717.04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“中国梦基金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	以上市公司基本面研究作为基础,通过专业化研究分析,积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会,在严格控制风险的前提下,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稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

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	蒋松云
	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	2014年6月9日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	35,224,208.51
本期利润	49,153,009.06
加权平均基金份额本期利润	0.0595
本期基金份额净值增长率	6.30%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0630
期末基金资产净值	299,101,430.34
期末基金份额净值	1.063

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。

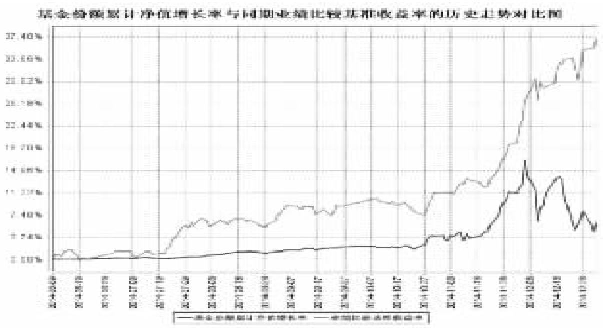
4.本基金合同生效日为2014年06月09日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

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	3.91%	1.30%	25.54%	0.99%	-21.63%	0.31%
过去六个月	6.19%	0.90%	35.92%	0.79%	-29.73%	0.11%
自基金合同生效起至今	6.30%	0.85%	37.26%	0.76%	-30.96%	0.09%

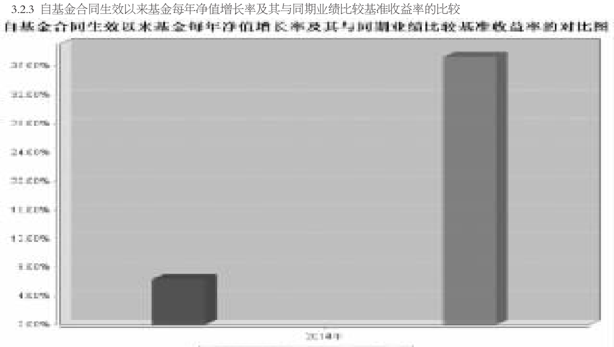
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.基金合同生效日至本报告期末不满一年。

2.本基金建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过往三年本基金未有利润分配事项。

§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)管理资产规模近3,000亿元,旗下管理57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		
彭砚	本基金基金经理	2014年6月9日	-	8年	南开大学金融学硕士,具有基金从业资格。曾任中银基金管理有限公司研究员、中银优选基金基金经理助理、助理副总裁(AVP)等职务;2010年6月至2013年5月,任中银策略基金基金经理;2010年8月至2013年5月,任中银价值基金基金经理。2013年6月加入南方基金,2014年1月至今,担任南方隆元基金经理;2014年6月至今,任南方中国梦基金经理。
蒋秋洁	本基金基金经理助理	2014年6月10日	2014年12月18日	6年	清华大学光电工程硕士学历,2008年7月加入南方基金,历任产品开发部研发员、研究部研究员、高级研究员,负责通信及传媒行业研究;2014年3月至2014年12月,任南方隆元基金经理助理;2014年6月至2014年12月,任南方中国梦基金经理助理;2014年12月至今,任南方消费基金经理。

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,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“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。

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《中国梦灵活配置混合型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7次,其中6次是由于指数型基金根据标的指数成份股调整而被动调仓所致,1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。

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

纵观2014年全年,市场在上半年整体平稳的状态下,下半年在金融、地产等权重板块的带领下,走出一波波澜壮阔的行情,沪深300指数全年收涨51.66%,大幅跑赢中小板指数的9.67%和创业板指数的12.83%。

本基金在2014年三季度打开申购赎回后,逐步增加了股票资产的配置,从行业配置的角度看,我们重点进行了互联网金融、地产、传媒、环保、核电等板块的配置,从投资效果看,由于在12月份低配了金融板块、超配了中小盘和创业板,使得组合在12月份表现较差,在指数大幅上涨的情况下净值回撤5%。

展望2015年,国内经济短期难以有大的起色,PMI持续走低,市场对于GDP持续走低预期一致,央行已经开始降息以降低社会融资成本,当然降息对经济的拉动效果如何,钱到底进入实体经济还是股市,经济的活力来自于哪些行业和领域我们需要客观判断。展望全年,我们需要关注的重点是经济的结构转型,未来在哪些行业哪些领域投资加速,将形成我们对2015年行业表现的主要判断依据。我们也要关注注册制、期权等对资本市场结构的影响。同时美国经济的快速复苏、就业市场的改善、油价以及美元走势可能是影响国内经济和股市的重要变量。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日为止,本基金的单位净值为1.063元,累计单位净值为1.063元。报告期内本基金净值增长率为6.30%,同期业绩基准增长率为37.26%,跑输基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本轮行情上涨的根源来自于改革和制度性红利,来自于对新一届政府执政能力的信心。展望2015年,市场经历短期快速上涨后短期存在一定回调的压力,对于全年的市场我们持中性偏乐观的态度,对于市场风格方面,全年我们看好白马成长股和一些细分行业龙头公司的表现。从行业角度看,我们认为以下几个行业有望获得超额收益:1)互联网,关注互联网金融、互联网医疗、O2O等,以及BAT重点投向的行业和领域;2)代表中国先进生产力的高新产业,如核电、高铁等;3)环保,行业过去几年的涨幅不大,新的一年国家可能在环保领域加大治理的力度;4)大金融板块,估值相对偏低;5)国企改革,国企是本轮释放制度红利的最主要方面,具有业绩和估值的双轮驱动。未来我们将一如既往地加大“自下而上”的研究力度。作为基金管理者,我们将依靠团队的努力和智慧,为投资人创造应有的回报。

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、权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及基金会计负责人等。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,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,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,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自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。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,本报告期本基金未有分配事项。

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,本基金托管人在对中国梦灵活配置混合型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,中国梦灵活配置混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在中国梦灵活配置混合型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,中国梦灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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中国梦灵活配置混合型证券投资基金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2014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(2015)第20394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:中国梦灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日
资产:	
银行存款	70,823,860.52
结算备付金	5,990,958.19
存出保证金	202,696.58
交易性金融资产	166,188,907.79
其中:股票投资	166,188,907.79
基金投资	-
债券投资	-
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	60,659,176.19
应收利息	25,492.49
应收股利	-
应收申购款	36,294.95
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	303,927,386.71
负债和所有者权益	本期末 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	-
应付赎回款	3,228,702.68
应付管理人报酬	453,708.78
应付托管费	75,618.13
应付销售服务费	-
应付交易费用	864,863.34
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	203,063.44
负债合计	4,825,956.37
所有者权益:	
实收基金	281,369,717.04
未分配利润	17,731,713.30
所有者权益合计	299,101,430.34
负债和所有者权益总计	303,927,386.71

注:1. 报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.063元,基金份额总额281,369,717.04份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:中国梦灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	59,514,354.26
1.利息收入	9,007,562.02
其中:存款利息收入	1,757,389.04
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	7,250,172.98
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	33,875,912.07
其中:股票投资收益	33,645,011.64
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	230,900.43
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	13,928,800.55
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,702,079.62
减:二、费用	10,361,345.20
1.管理人报酬	7,005,491.76
2.托管费	1,167,582.01
3.销售服务费	-
4.交易费用	1,943,016.60
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	245,254.83
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	49,153,009.06
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	49,153,009.06

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中国梦灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月9日(基金合同生效日)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)	1,194,190,882.26	-	1,194,190,882.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	49,153,009.06	49,153,009.06
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)	-912,821,165.22	-31,421,295.76	-944,242,460.98
其中:1.基金申购款	52,866,756.62	4,106,251.17	56,973,007.79
2.基金赎回款	-965,687,921.84	-35,527,546.93	-1,001,215,468.77
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)	281,369,717.04	17,731,713.30	299,101,430.34

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 基金基本情况

中国梦灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]98号《关于核准中国梦灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中国梦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,193,853,142.18元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第341号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中国梦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年6月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,194,190,882.26份,其中认购资金利息折合337,740.08份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中国梦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的各类股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、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。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为0-95%;债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的5%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于2015年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国梦灵活配置混合型证券投资基金》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况以及2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》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,暂减按25%计入应纳税所得额。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。

7.4.7 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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券	38,875,531.27	2.94%
华泰证券	265,389,416.53	20.04%

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年6月9日(基金合同生效日)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
兴业证券	34,401.09	2.91%	-	-
华泰证券	234,843.35	19.85%	232,542.78	26.89%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,005,491.76
其中:支付销售机构的客户维护费	1,796,244.36

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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,167,582.01

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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 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 2014年6月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	70,823,860.52	1,498,282.91

注:本基金的银行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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 利润分配情况

无。

7.4.10期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.10.2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
002018	华信国际	2014/11/19	重大资产重组	13.99	2015/03/06	15.39	706,821	9,622,985.72	9,888,425.79	-
300248	新开普	2014/11/17	重大资产重组	33.24	2015/02/16	34.91	232,100	7,319,204.50	7,715,004.00	
300183	东软载波	2014/09/29	重大事项	54.78	2015/01/05	47.42	131,939	6,944,756.84	7,227,618.42	-
000925	众合机电	2014/12/31	重大事项	21.40	2015/01/12	21.65	271,572	6,245,806.77	5,811,640.80	-
600745	中茵股份	2014/12/10	重大资产重组	15.83	未知	未知	349,187	5,095,507.26	5,527,630.21	-

注:本基金截至2014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。

7.4.10.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1银行间市场债券正回购

无。

7.4.10.3.2交易所市场债券正回购

无。

§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	166,188,907.79	54.68
	其中:股票	166,188,907.79	54.68
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	76,814,818.71	25.27
7	其他各项资产	60,923,660.21	20.05
8	合计	303,927,386.71	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	62,494,827.34	20.89
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	5,879,293.36	1.97
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	57,276,768.95	19.15
J	金融业	7,448,587.00	2.49
K	房地产业	28,859,095.14	9.65
L	租赁和商务服务业	4,230,336.00	1.41
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	166,188,907.79	55.56

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600208	新湖中宝	2,700,046	19,764,336.72	6.61
2	002318	久立特材	550,096	16,436,868.48	5.50
3	600446	金证股份	300,095	14,068,453.60	4.70
4	600570	恒生电子	227,200	12,441,472.00	4.16
5	002018	华星国际	706,821	9,888,425.79	3.31
6	300248	新开普	232,100	7,715,004.00	2.58
7	601318	中国平安	99,700	7,448,587.00	2.49
8	300183	东软载波	131,939	7,227,618.42	2.42
9	300202	聚龙股份	202,410	6,252,444.90	2.09
10	300257	开山股份	172,512	6,072,422.40	2.03

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002318	久立特材	22,329,845.52	7.47
2	600446	金证股份	21,602,106.93	7.22
3	002421	达实智能	19,436,047.13	6.50
4	300309	吉艾科技	18,537,471.99	6.20
5	000925	众合机电	17,802,016.60	5.95
6	600208	新湖中宝	17,447,792.90	5.83
7	000712	锦龙股份	16,646,606.36	5.57
8	002358	森源电气	14,211,869.92	4.75
9	000625	长安汽车	14,029,998.11	4.69
10	600570	恒生电子	12,932,207.50	4.32
11	300238	冠昊生物	12,797,648.38	4.28
12	002657	中科金财	12,677,503.23	4.24
13	600120	浙江东方	12,293,807.32	4.11
14	002431	棕榈园林	11,980,249.95	4.01
15	002236	大华股份	11,520,640.10	3.85
16	300010	立思辰	11,131,581.41	3.72
17	300323	华灿光电	10,869,729.01	3.63
18	600455	博通股份	10,415,822.74	3.48
19	600100	同方股份	9,829,084.74	3.29
20	002642	荣之联	9,632,028.80	3.22
21	002018	华星国际	9,622,985.72	3.22
22	600773	西藏城投	9,460,453.32	3.16
23	600016	民生银行	9,449,928.11	3.16
24	600745	中茵股份	9,336,843.20	3.12
25	600651	飞乐音响	9,230,855.63	3.09
26	300322	硕贝德	9,079,979.00	3.04
27	300166	东方国信	9,000,976.29	3.01
28	300257	开山股份	8,735,220.70	2.92
29	000158	常山股份	8,470,025.60	2.83
30	002649	博彦科技	8,460,515.50	2.83
31	000748	长城信息	8,447,869.11	2.82
32	600048	保利地产	8,157,983.19	2.73
33	002520	日发精机	8,124,987.18	2.72
34	300377	赢时胜	8,092,644.39	2.71
35	600979	广安爱众	8,085,124.42	2.70
36	600662	强生控股	7,834,977.78	2.62
37	601988	中国银行	7,830,711.00	2.62
38	300253	卫宁软件	7,767,506.35	2.60
39	000671	阳光城	7,530,801.47	2.52
40	300202	聚龙股份	7,323,794.11	2.45
41	300248	新开普	7,319,204.50	2.45
42	300285	国瓷材料	7,076,008.05	2.37
43	300183	东软载波	6,944,756.84	2.32
44	300340	科恒股份	6,897,711.92	2.31
45	002153	石基信息	6,895,655.30	2.31
46	300101	振芯科技	6,871,965.22	2.30
47	300333	兆日科技	6,868,339.00	2.30
48	000059	华锦股份	6,817,410.00	2.28
49	002410	广联达	6,768,402.37	2.26
50	300295	三六五网	6,278,120.69	2.10
51	600108	亚盛集团	6,041,980.00	2.02
52	002638	勤上光电	6,031,508.07	2.02
53	002181	粤传媒	6,025,393.61	2.01

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300309	吉艾科技	21,152,016.26	7.07
2	000712	锦龙股份	20,274,376.87	6.78
3	002358	森源电气	18,612,091.49	6.22
4	600446	金证股份	15,542,183.96	5.20
5	002421	达实智能	15,500,261.18	5.18
6	002657	中科金财	15,376,962.66	5.14
7	600208	新湖中宝	14,555,351.60	4.87
8	000625	长安汽车	13,448,765.36	4.50
9	002431	棕榈园林	11,865,421.27	3.97
10	300238	冠昊生物	11,750,204.94	3.93
11	002236	大华股份	11,240,179.11	3.76
12	002642	荣之联	10,977,041.64	3.67
13	300323	华灿光电	10,862,488.28	3.63
14	300010	立思辰	10,812,756.57	3.62
15	600455	博通股份	10,551,486.71	3.53
16	000925	众合机电	10,414,132.74	3.48
17	300166	东方国信	10,394,457.14	3.48
18	600016	民生银行	9,857,343.00	3.30
19	600120	浙江东方	9,844,280.96	3.29
20	600773	西藏城投	9,529,429.65	3.19
21	600100	同方股份	9,407,369.00	3.15
22	600651	飞乐音响	9,344,977.39	3.12
23	300377	赢时胜	9,152,037.54	3.06
24	002318	久立特材	8,936,792.00	2.99
25	000748	长城信息	8,878,327.20	2.97
26	000158	常山股份	8,781,980.72	2.94
27	300322	硕贝德	8,458,241.11	2.83
28	002649	博彦科技	8,438,181.13	2.82
29	002520	日发精机	8,431,405.15	2.82
30	600048	保利地产	8,246,523.48	2.76
31	300333	兆日科技	8,214,789.04	2.75
32	600979	广安爱众	7,824,886.20	2.62
33	600662	强生控股	7,761,271.88	2.59
34	002181	粤传媒	7,605,295.70	2.54
35	601988	中国银行	7,166,406.00	2.40
36	300101	振芯科技	7,161,245.12	2.39
37	000059	华锦股份	6,834,210.13	2.28
38	002410	广联达	6,747,593.31	2.26
39	600176	中国玻纤	6,291,091.25	2.10
40	300340	科恒股份	6,233,164.04	2.08
41	002245	澳洋顺昌	6,201,103.47	2.07
42	002638	勤上光电	6,176,852.19	2.07
43	601555	东吴证券	6,149,753.00	2.06
44	600999	招商证券	6,011,856.00	2.01

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	723,675,283.63
卖出股票收入(成交)总额	605,060,188.03

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	202,696.58
2	应收证券清算款	60,659,176.19
3	应收股利	-
4	应收利息	25,492.49
5	应收申购款	36,294.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,923,660.21

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	9,888,425.79	3.31	重大资产重组
2	300248	新开普	7,715,004.00	2.58	重大资产重组
3	300183	东软载波	7,227,618.42	2.42	重大事项停牌

§9 基金份额持有人信息

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
2,765	101,761.20	97,457,310.03	34.64%	183,912,407.01	65.36%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	983,074.99	0.3494%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年6月9日)基金份额总额	1,194,190,882.26
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	52,866,756.62
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	965,687,921.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	281,369,717.04

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内,因中国工商银行股份有限公司(以下简称“本行”)工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

本报告期内,本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

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,无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用91,000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	8,171,276.12	0.62%	7,439.28	0.63%	-
海通证券	1	224,045,746.65	16.92%	203,971.20	17.24%	-
华泰证券	1	265,389,416.53	20.04%	234,843.35	19.85%	-
瑞银证券	1	22,695,859.98	1.71%	20,662.65	1.75%	-
西南证券	1	72,900,184.87	5.50%	66,368.06	5.61%	-
兴业证券	1	38,875,531.27	2.94%	34,401.09	2.91%	-
招商证券	1	99,653,528.45	7.52%	90,724.84	7.67%	-
中信建投	1	592,802,303.94	44.76%	524,571.82	44.34%	-

注:1、为节约交易单元资源,我公司在交易所交易系统升级的基础上,对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序:

A:选择标准

a、公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;

b、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

c、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

d、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B:选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择交易单元:

a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	3,129,000,000.00	8.56%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	573,500,000.00	1.57%	-	-
西南证券	-	-	2,648,000,000.00	7.25%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	30,195,900,000.00	82.62%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-