

行业类别		公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	2,975,472.42	0.09
C	制造业	900,915,062.53	25.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	144,040,533.62	4.13
E	建筑业	104,120,106.65	2.92
F	批发和零售业	171,633,199.65	4.98
G	交通运输、仓储和邮政业	45,807,185.19	1.31
H	住宿和餐饮业	3,239.19	0.00
I	信息技术、软件和信息技术服务业	281,492,842.73	8.07
J	金融业	673,130,966.82	19.29
K	房地产业	148,721,436.32	4.26
L	租赁和商务服务业	6,578,040.35	0.19
M	科学研究和技术服务业	1,382.22	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	171,491,133.60	4.92
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	2,439,720.00	0.07
S	综合	44,277,712.20	1.27
合计		2,697,628,397.47	77.32

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债券投资明细					
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	601318	中国平安	1,999,998	149,419,850.58	4.28
2	000543	宁德时代	9,699,829	124,545,804.36	3.57
3	601628	中国人寿	3,376,772	115,316,763.80	3.31
4	300070	碧水源	2,876,122	100,089,045.60	2.87
5	601166	兴业银行	5,000,000	82,500,000.00	2.36
6	600046	金证股份	1,750,388	82,058,189.44	2.36
7	600036	招商银行	4,700,000	77,973,000.00	2.23
8	000625	长安汽车	4,695,254	77,143,023.22	2.21
9	000669	华联城A	8,499,928	70,124,406.00	2.01
10	601818	光大银行	13,999,983	68,319,917.04	1.96

4.期末按债券品种分类的债券投资组合				
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	国家债券	38,164,723.43	1.09	
2	央行票据	-	-	
3	金融债券	707,444,244.80	20.28	
	其中:政策性金融债	707,444,244.80	20.28	
4	企业债券	-	-	
5	企业短期融资券	-	-	
6	中期票据	-	-	
7	可转债	2,035,000.00	0.06	
8	其他	-	-	
9	合计	747,643,968.23	21.43	

5.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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080220	08国债20	3,000,000	294,000,000.00	8.43
2	100401	10财国债1	800,000	79,960,000.00	2.29
3	018002	国开1302	616,000	66,096,800.00	1.89
4	140218	14国开18	500,000	50,035,000.00	1.43
5	050510	05国开10债	500,000	49,805,000.00	1.43

6.期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

7.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

8.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

9.投资组合报告附注

9.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过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。

9.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

9.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,202,192.78
2	应收证券清算款	4,008,158.80
3	应收利息	-
4	应收股利	13,360,155.66
5	应收申购款	135,723.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,706,230.79

9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十一、基金业绩

本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,也不保证收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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。

基金业绩增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准③	净值比较基准差④	①-③	②-④
2001.9.28-2001.12.31	0.37%	0.28%	-	-	0.37%	0.28%
2002年	-6.71%	0.55%	-	-	-6.71%	0.55%
2003年	25.15%	0.76%	-	-	25.15%	0.76%
2004年	2.61%	0.91%	-	-	2.61%	0.91%
2005年	3.83%	0.96%	-	-	3.83%	0.96%
2006年	100.97%	1.51%	-	-	100.97%	1.51%
2007年	123.63%	1.73%	-	-	123.63%	1.73%
2008年	-52.94%	2.02%	-	-	-52.94%	2.02%
2009年	44.61%	1.44%	-	-	44.61%	1.44%
2010年	-7.23%	1.51%	-	-	-7.23%	1.51%
2011年	-20.83%	0.91%	-	-	-20.83%	0.91%
2012年	-0.71%	0.88%	-	-	-0.71%	0.88%
2013年	5.35%	1.05%	-	-	5.35%	1.05%
2014年	21.07%	0.96%	0.00%	0.00%	21.07%	0.96%
自基金合同生效起至今	255.12%	1.21%	0.00%	0.00%	255.12%	1.21%

十二、基金费用概览

1.基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)证券交易费用;

(4)基金信息披露费用;

(5)基金持有人大会费用;

(6)与基金有关的会计师事务所和律师费;

(7)按照基金合同约定可以列入的其他费用。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理人的管理费以基金资产净值的1.5%年费率计提,具体计算方法如下:

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:

$$H=E\times 1.5\div 365$$

H为每日应付的基金管理费

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,由基金托管人于次月首两个工作日内从应付的基金资产中支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

本基金应当支付基金托管人托管费,按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,计算方法如下:

$$H=E\times 0.25\div 365$$

H为每日应付的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提,按月支付,由基金托管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H(1)至(3)项(7)项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

3.不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

其他基金不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

4.费用调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费,下调费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

5.其他费用

本基金其他费用按照相关法律法规执行。

6.基金税收

本基金运作过程中的各类纳税义务,依照国家法律法规的规定,履行纳税义务。

(二)与基金销售有关费用

1.申购费率按申购金额的增加而递减,如下表所示:

申购金额	申购费率
M<100万	1.6%
100万≤M<1000万	1.3%
M≥1000万	每笔1,000元

2.赎回费率为0.5%,赎回费在扣除手续费后,余额不得低于赎回费总额的百分之二十,并应当归入基金财产。

3.本基金的申购赎回费率由基金管理人根据基金合同约定的范围内调整,本基金的申购费和赎回费率在更新的招募说明书中列示。基金管理人认为需要调整费率时,必须于新的费率开始实施日的三个工作日在至少一种中国证监会指定的报刊和网站上刊登公告。

4.基金管理人和其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下,对基金销售费用实行一定的优惠,费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。十二、招募说明书中更新部分说明 本基金管理人按照有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下: - 1.在“基金管理人”部分,对基金管理人相关信息进行了更新。 - 2.在“基金托管人”部分,对基金托管人相关信息进行了更新。 - 3.在“相关服务机构”部分,对基金代销机构的相关信息进行了更新。 - 4.在“基金份额的申购和赎回”部分,对本基金申购与赎回的数量限制相关信息进行了更新。 - 5.在“基金的投资”部分,更新了本基金最近一期投资组合报告。 - 6.在“基金业绩”部分,补充更新了基金最近一期的投资业绩。 - 7.对“基金份额持有人服务”进行了更新。 - 8.对“其他应披露事项”进行了更新。 - 9.对其他部分内容进行了更新。 南方基金66