

## 南方积极配置混合型证券投资基金

## [2015]第三季度报告

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  
报告送出日期:2015年10月27日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	南方积极配置混合(FOF)
场内简称	南方积极
交易代码	160106
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2004年10月14日
报告期末基金份额总额	798,214,155.96份
投资目标	本基金为混合型基金，通过积极操作进行资产配置和行业配置，在时机成熟时择机调整，力争在控制风险并保持良好流动性的前提下，为投资者寻求较高的投资收益。
投资策略	本基金策略是“积极配置”策略，即在投资策略上，通过资产配置并保持流动性的前提下，为投资者寻求较高的投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩基准是“积极配置”策略，即在投资策略上，通过资产配置并保持流动性的前提下，为投资者寻求较高的投资收益。
风险收益特征	本基金为积极型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。
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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1本期已实现收益 -72,026,700.74

2本期利润 -293,044,700.69

3期初现金及现金等价物余额 -3,769

4期末现金及现金等价物余额 1,091,132,113.12

5期末现金及现金等价物余额 1,2843

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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差(%) ① - ③ ② - ④

过去三个月 -20.82% 3.44% -24.44% 2.79% 3.62% 0.69%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

图:南方积极配置混合型证券投资基金2015年7月1日至2015年9月30日净值增长率与业绩比较基准收益率变动情况

注:本基金在报告期前十名股票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处罚或被调查处罚的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金严格执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各业务环节严格执行交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期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时段内买卖股票成交较少的单边交易量占该时段成交量的5%的交易次数为0次，其中2次是由指数型基金根据其指数成份股的成交金额和成交数量所决定的，2次是由于指数型基金接受投资者申购后被增减仓所致，1次是由于投资组合的投资策略需要，相关投资组合已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内严格执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各业务环节严格执行交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.2 报告期内本基金执行公平交易的说明

本基金报告期内，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、中国证监会和南方积极配置混合型证券投资基金合同的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合规，没有损害基金份额持有人利益。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。

4.4.3 公平交易专项说明

4.4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金严格执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各业务环节严格执行交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期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时段内买卖股票成交较少的单边交易量占该时段成交量的5%的交易次数为0次，其中2次是由指数型基金根据其指数成份股的成交金额和成交数量所决定的，2次是由于指数型基金接受投资者申购后被增减仓所致，1次是由于投资组合的投资策略需要，相关投资组合已提供决策依据并留存记录备查。

4.5 报告期内基金的业绩表现

4.5.1 基金投资组合的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股库。

4.5.1.1 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 1,483,630.23

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 403,622.66

4 应收申购款 235,633.06

5 其他资产 -

6 待摊费用 -

7 其他 -

8 其他 -

9 合计 2,212,788.64

5.5 报告期未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

注:本基金未投资于债券及债券支持证券。

5.5.1 报告期未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

注:本基金未投资于贵金属。

5.5.2 报告期未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

注:本基金未报告期未投资于权证。

5.5.3 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

注:本基金未报告期未投资于股指期货。

5.5.4 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明

注:本基金未报告期未投资于国债期货。

5.5.5 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

注:本基金未投资于资产支持证券。

5.5.6 报告期未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

注:本基金未报告期未投资于权证。

5.5.7 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

注:本基金未报告期未投资于股指期货。

5.5.8 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明

注:本基金未报告期未投资于国债期货。

5.5.9 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

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“南方基金”。

5.5.10 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.11 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.12 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.13 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.14 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

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“南方基金”。

5.5.15 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.16 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.17 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.18 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.19 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

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“南方基金”。

5.5.20 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.21 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.22 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.23 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.24 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

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“南方基金”。

5.5.25 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.26 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.27 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.28 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.29 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

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“南方基金”。

5.5.30 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.31 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.32 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.33 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明

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“南方基金”。

5.5.34 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

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“南方基金”。

5.5.35 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.36 报告期未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

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“南方基金”。

5.5.37 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明

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“南方基金”。