

南方顺达保本混合型证券投资基金

2015 年 度 报 告 摘 要

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
公告送达日期：2016年3月30日

1.1 目录提示
基金管理人的基本情况、基金的运作特点及主要风险、基金的收益与损失、对基金的内容的真实性、准确性和完整性承担个别和连带责任。本公司没有二十二章“基金合同的内容摘要”和“基金合同的变更、终止和清算”。
基金管理人和基金托管人根据二十二章“基金合同的内容摘要”和“基金合同的变更、终止和清算”的原则，对基金中的财务指标、净值表现、利润分配情况、费用计提方法、费率标准、申购和赎回价格、基金持有人的权利和义务、基金的名称、基金的类别、基金的风险收益特征、基金的业绩基准、基金的估值方法、基金的收益分配政策、基金的费用计提方法、基金的财产投资方向和投资限制、基金的流动性风险控制方法、基金的风险揭示、基金的售后服务等进行约定。
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。
本基金的过往业绩并不代表未来表现。投资风格、投资范围在投资运作前请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本报告期内2015年10月28日至2015年12月31日。

本年度报告摘要由基金管理人负责制作并经基金管理人批准。报告摘要的目的在于使基金投资者了解报告期末基金的有关情况。

§ 2 基金简介

基金简称：

南方顺达保本混合型证券投资基金

基金代码：

000236

运作方式：

契约型开放式

上市地：

深圳证券交易所

成立日：

2016年10月28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：

2,079,388,098.00

基金合同的存续期间：

不定期

基金类别：

基金类别：保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

基金投资目标：

本基金在严格控制本金安全的前提下，有效控制风险，追求资产的稳定增值。

基金投资策略：

本基金采用固定比例投资策略（Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPI）来实现保本和增值的目标。固定比例保险策略是通过将基金资产分为两个部分：一部分投资于货币市场工具，另一部分投资于股票、债券等风险资产，从而在保本机制下使股票市场的长期性获得一定的程度的保证。

基金业绩基准：

3%定存+定期存款税后收益+0.05%

风险收益特征：

本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

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

姓名 韩文波 洪润

信息披露负责人 联系电话 0755-2763888 010-66106799

电子邮箱 manager@nffund.com custody@icbc.com.cn

客户服务电话 400-889-8899 96688

传真 0755-27638899 010-66106798

2.4 会计报表披露

载登年度报告正文的管理人互联网网址 http://www.nffund.com

基金管理人报告备置地点 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 本期利润和亏损

2015年10月28日基金合同生效日-2015年12月31日

本期已实现收益 8,340,359.84

本期利润 17,917,806.79

加权平均基金份额本期利润率 0.06%

3.1.2 本期利润和亏损

2015年末

期末可供分配基金份额利润 73,000.00

期末基金资产净值 2,997,306,903.88

期末基金份额 1,000.00

注：1.本期利润为基金本期至报告期末按单日每份收益乘以当年天数（即31天）再减去期间费用后的余额，本期利润不为当期损益。
2.期末可供分配利润指截至期末按摊余成本计算的基金可供分配利润。
3.所列基金业绩指标仅包括持有人认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资、基金转换等业务对基金净值的影响，不包括持有人申购或赎回基金份额时产生的申购或赎回费用。
4.本基金合同生效日为2015年10月28日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2 基金的资产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 累计净值增长率 业绩比较基准收益率差值 (%) ①-③ ②-④

自基金合同生效日起至今 0.60% 0.05% 0.65% 0.00% 0.01% 0.06%

3.2.1 基金的资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目 附注号 本期末

2015年12月31日

负债和所有者权益 附注号 本期末

2015年12月31日

负债：

银行存款 14,117,197.45

结算备付金 32,832,026.54

存出保证金 68,156.91

交易金融资产 1,819,485,493.14

其中：股票投资 119,673,373.34

基金投资 -

债券投资 1,699,812,089.80

资产支持证券投资 -

衍生金融资产 -

买入返售金融资产 1,136,541,263.31

应收证券清算款 400,172,481.61

应收利息 7,106,536.49

应收股利 -

应收申购款 -

其他应收款 -

应付证券清算款 4,280,556.02

应付利息 507,169.36

应付股利 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 407,000,000.00

应付证券融资款 -

应付期货保证金 -

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 4,280,556.02

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 407,000,000.00

应付证券融资款 -

应付期货保证金 -

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 4,280,556.02

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 407,000,000.00

应付证券融资款 -

应付期货保证金 -

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 4,280,556.02

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 407,000,000.00

应付证券融资款 -

应付期货保证金 -

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 4,280,556.02

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 407,000,000.00

应付证券融资款 -

应付期货保证金 -

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 4,280,556.02

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 407,000,000.00

应付证券融资款 -

应付期货保证金 -

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 4,280,556.02

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 407,000,000.00

应付证券融资款 -

应付期货保证金 -

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 4,280,556.02

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 407,000,000.00

应付证券融资款 -

应付期货保证金 -

应付赎回款 -

应付申购款 -

应付赎回款 -

应付证券借贷款 4,280,556.02

应付赎回款 -