（上接B121版）

| | | |
|---|---|---|
| 73 | 中期资产管理有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号<br>办公地址:北京市朝阳区光华路16号中期大厦2层<br>法定代表人:朱剑林<br>联系人:侯英建<br>电话:010-65807865<br>传真:010-65807864<br>客服电话:010-65807609<br>网址:http://www.cifcofund.com |
| 74 | 万银财富(北京)基金销售有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内<br>办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内<br>法定代表人:王斐<br>联系人:张莉<br>电话:010-53300532<br>传真:010-59393074<br>客服电话:400-081-6655<br>网址:www.wy-fund.com |
| 75 | 和讯信息科技有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层<br>办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层<br>法定代表人:王莉<br>联系人:张紫薇<br>电话:0755-82021122<br>传真:0755-82029055<br>客服电话:4009200022<br>网址:licaike.hexun.com |
| 76 | 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809<br>办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809<br>法定代表人:沈伟桦<br>联系人:程刚<br>电话:010-52855713<br>传真:010-85894285<br>客服电话:4006099200<br>网址:www.yixinfund.com |
| 77 | 浙江金观诚财富管理有限公司 | 注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室<br>办公地址:杭州市拱墅区登云路43号金诚集团(锦昌大厦)13楼<br>法定代表人:陈峥<br>联系人:邓秀男<br>电话:0571-88337734<br>传真:0571-88337666<br>客服电话:400-068-0058<br>网址:www.jincheng-fund.com |
| 78 | 泛华普益基金销售有限公司 | 注册地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室<br>办公地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室<br>法定代表人:于海锋<br>联系人:邓鹏<br>电话:13981713068<br>传真:028-82000996-805<br>客服电话:400-8588588<br>网址:http://www.pyfund.cn |
| 79 | 嘉实财富管理有限公司 | 注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元<br>办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元<br>法定代表人:赵学军<br>联系人:樊琪<br>电话:021-20289890<br>传真:021-20280110<br>客服电话:400-021-8850<br>网址:www.harvestwm.cn |
| 80 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#<br>办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层<br>法定代表人:杨鹏<br>联系人:张燕<br>电话:010-58325388*1588<br>传真:010-58325282<br>客服电话:400-166-1188<br>网址:https/8.jrj.com.cn |
| 81 | 北京恒天明泽基金销售有限公司 | 注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室<br>办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层<br>法定代表人:梁越<br>联系人:马鹏程<br>电话:010-56810780<br>传真:010-57756199<br>客服电话:400-786-8868-5<br>网址:www.chtfund.com |
| 82 | 北京钱景财富投资管理有限公司 | 注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012<br>办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012<br>法定代表人:赵荣春<br>联系人:魏争<br>电话:010-57418829<br>传真:010-57569671<br>客服电话:400-678-5095<br>网址:www.niuji.net |
| 83 | 深圳宜投基金销售有限公司 | 注册地址:深圳市南山区粤兴二道6号武汉大学深圳产学研大楼B815房(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)<br>办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405<br>法定代表人:华建强<br>联系人:黄品龙<br>电话:0755-23601676<br>传真:0755-88603185<br>客服电话:4008955811<br>网址:www.ucffund.com |
| 84 | 中国国际期货有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层,2层,9层,11层,12层<br>办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层<br>法定代表人:王兵<br>联系人:赵森<br>电话:010-59539864<br>传真:010-59539985<br>客服电话:95162.400-8888-160<br>网址:www.cifco.net |
| 85 | 北京创金启富投资管理有限公司 | 注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A<br>办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A<br>法定代表人:梁蓉<br>联系人:张旭<br>电话:010-66154828<br>传真:010-88067526<br>客服电话:400-6262-818<br>网址:www.5rich.com |
| 86 | 海银基金销售有限公司 | 注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元<br>办公地址:上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场16楼<br>法定代表人:刘惠<br>联系人:刘艳妮<br>电话:021-80133827<br>传真:021-80133413<br>客服电话:400-808-1016<br>网址:www.fundhaiyin.com |
| 87 | 上海联泰资产管理有限公司 | 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室<br>办公地址:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼<br>法定代表人:燕斌<br>联系人:沛珊<br>电话:021-51507071<br>传真:021-62990063<br>客服电话:4000-466-788<br>网址:http://www.66money.com |
| 88 | 北京增财基金销售有限公司 | 注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208<br>办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208<br>法定代表人:罗细安<br>联系人:史丽丽<br>电话:010-67000988-6028<br>传真:010-67000988-6000<br>客服电话:010-67000988<br>网址:www.zcvc.com.cn |
| 89 | 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室<br>办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼<br>法定代表人:沈继伟<br>联系人:赵沛然<br>电话:021-50583533<br>传真:021-50583633<br>客服电话:4000676266<br>网址:www.leadfund.com.cn |
| 90 | 上海汇付金融服务有限公司 | 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室<br>办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室<br>办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼<br>法定代表人:张晶<br>联系人:周丹<br>电话:021-33323999<br>传真:021-33323993<br>客服电话:400-820-2819<br>手机客户端:天天盈基金 |
| 91 | 本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告 | |

名称:南方基金管理有限公司
住所及办公地址:深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层
法定代表人:吴万善
电话:（0755）82763849
传真:（0755）82763889
联系人:古和鹏
3.3山具法律意见书的律师事务所
名称:广东华商律师事务所
注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室
负责人:李兆良
电话:(0755)82687860
传真:(0755)82687861
经办律师:杨忠、戴瑞冬
3.4审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:杨绍信
联系人:陈熹
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:汪棣 陈熹

§4基金名称

南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

§5基金的类型

混合型证券投资基金

§6基金的投资目标

灵活应用多种绝对收益策略对冲本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值。

§7基金的投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）,股指期货、权证、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、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,封闭期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%。

开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

§8基金的投资策略

本基金力争通过合理判断市场走势,合理配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例,本基金主要采用市场中性的投资策略,通过定量和定性相结合的方法精选个股,并通过卖出股指期货合约对冲系统性风险,力争实现稳定的绝对回报。

1、资产配置策略

本基金资产配置策略主要是以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等,判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势,确定和构造合适的资产配置比例。

本基金的资产配置重点是对于股票现货和卖出股指期货合约价值之间的调配。为了实现规避股票市场系统性风险,获取较高的绝对收益的目的,本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。基金经理和风险管理人员运用定性和定量方法分析投资组合、股票市场的风险水平以及资产类别间的相对风险水平，以风险调整后回报（risk-adjusted returns）的高低决定权益类资产的净敞口的比例。

2、多头投资策略

本基金的多头策略有股票多头策略和股指期货多头策略，但现阶段主要以定量和定性相结合的方法精选个股为主导策略,以获取稳定的超额收益（alpha）为股票投资的目标。

本基金通过定量和定性相结合的方法精选个股。主要需要考虑的方面包括上市公司治理结构、核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况以及公司基本面变化等,并对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司构建多头组合。

3、空头工具投资策略

本基金现阶段主要通过卖出股指期货合约,对冲持有股票的系统性风险。本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,力争获得稳定的正向超额收益。

为更好地控制市场风险，本基金将保持隔夜现金中性（Overnight Dollar Neutral）,即每日收盘时股票现货与卖出的股指期货的价值基本匹配。基于管理人对后市的预测分析,上述比例可能有所偏离,但权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。

4、其他绝对收益策略

本基金采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差,捕捉绝对收益机会。同时,本基金根据市场情况的变化,灵活运用其他绝对收益策略（如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等）策略提高资本的利用率,从而提高绝对收益,达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

（1）股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系,进行套利,以获取绝对收益。股指期货套利主要包括以下两种方式:

①期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动,套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

②跨期套利

跨期套利过程中,不同期货合约之间的价差不断变动,套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

（2）其他绝对收益策略

基金经理会实时关注市场的发展,前瞻性地运用其他绝对收益策略。

5、风险控制策略

本基金将采用多种风险控制策略和工具，对投资组合进行量化风险监测和控制。风险的衡量主要是投资组合的风险价值（Value-at-Risk,简称VaR）来衡量。VaR指在一定的概率水平下（置信度）,某一金融资产或证券组合在未来特定的一段时间内的最大可能损失。VaR的特点是可以用来简单清晰的表示市场风险的大小，对于一般投资者而言不需要进行复杂的计算就能方便的对风险的大小进行评判。VaR不仅可以和其他风险管理方法一样在事后衡量风险大小,可以在事前计算风险;不仅能计算单个金融工具的风险,还能计算由多个金融工具组成的投资组合风险。资产管理人还将进行投资组合在较差环境下的压力测试和各种情景分析,充分考虑并做好相应的止损准备。

6、债券投资策略

首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期和债券组合结构;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中,我们采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。

7、中小企业私募债投资策略

由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,并限制投资人数量上限,整体流动性相对较差。同时,受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中,应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为,投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面,并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素,确定最终的投资决策。

8、权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

§9基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准,经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,且无需召开基金份额持有人大会。

§10基金的风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险,因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准,由于绝对收益策略投资结果的不确定性,因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

§11基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定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。

本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日（未经审计）。

1.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 276,377,129.11 | 9.91 |
| | 其中:股票 | 276,377,129.11 | 9.91 |
| 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 | 2,270,000,000.00 | 81.39 |
| | 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 | 185,679,132.09 | 6.66 |
| 7 | 其他资产 | 56,963,866.58 | 2.04 |
| 8 | 合计 | 2,789,020,127.78 | 100.00 |

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 746,946.40 | 0.03 |
| B | 采矿业 | 10,902,549.13 | 0.39 |
| C | 制造业 | 100,005,788.40 | 3.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,224,947.52 | 0.26 |
| E | 建筑业 | 14,332,365.73 | 0.52 |
| F | 批发和零售业 | 6,351,907.47 | 0.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,276,600.41 | 0.23 |
| H | 住宿和餐饮业 | 20,132.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 12,453,523.71 | 0.45 |
| J | 金融业 | 85,957,205.86 | 3.11 |
| K | 房地产业 | 11,467,846.71 | 0.42 |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,823,118.84 | 0.39 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 484.12 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,945,782.84 | 0.18 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 229,834.35 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,915,537.50 | 0.14 |
| S | 综合 | 722,558.12 | 0.03 |
| | 合计 | 276,377,129.11 | 10.01 |

1.3 报告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

| 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 | 115,549 | 9,040,553.76 | 0.33 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 876,103 | 8,498,199.10 | 0.31 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 212,976 | 6,989,872.32 | 0.25 |
| 4 | 600837 | 海通证券 | 278,136 | 6,511,163.76 | 0.24 |
| 5 | 000415 | 渤海租赁 | 446,000 | 5,878,280.00 | 0.21 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 366,262 | 5,702,699.34 | 0.21 |
| 7 | 601328 | 交通银行 | 804,846 | 5,142,965.94 | 0.19 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 248,994 | 4,571,529.84 | 0.17 |
| 9 | 600000 | 浦发银行 | 248,251 | 3,919,883.29 | 0.14 |
| 10 | 603030 | 全筑股份 | 138,965 | 3,842,382.25 | 0.14 |

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。
1.5 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债券投资明细
注:本基金本报告期末未持有债券。
1.6 报告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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
1.7 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
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
1.8 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IF1504 | IF1504 | -46 | -55,936,920.00 | -1,342,860.11 | - |
| IF1506 | IF1506 | -160 | -195,542,400.00 | -20,711,153.05 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -22,054,013.16 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | 22,574,712.50 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -4,058,232.50 |

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,力争获得稳定的正向超额收益。
1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未投资国债期货。
1.11 投资组合报告附注
1.11.1
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。
1.11.2
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。
1.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 28,328,615.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | 27,639,104.24 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 996,146.38 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 56,963,866.58 |

1.11.4 报告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。
1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000415 | 渤海租赁 | 5,878,280.00 | 0.21 | 临时停牌 |

§12基金业绩

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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2014.12.1-2014.12.31 | 1.90% | 0.60% | 0.40% | 0.01% | 1.50% | 0.59% |
| 2015.1.1-2015.3.31 | 5.39% | 0.49% | 1.15% | 0.02% | 4.24% | 0.47% |
| 自基金成立-2015.3.31 | 7.39% | 0.52% | 1.55% | 0.01% | 5.84% | 0.51% |

§13基金的费用概览

13.1与基金运作有关的费用
一、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
二、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为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中,基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下:

（1）基金管理人的基本管理费

本基金的基本管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。基本管理费的计算方法如下:

H＝E×1%÷当年天数
H为每日应计提的基金基本管理费
E为前一日的基金资产净值

基金基本管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

（2）基金管理人的附加管理费

1）基金管理人可在同时满足以下条件的前提下,提取附加管理费:

①符合基金收益分配条件

②附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的10%作为附加管理费:即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和1的孰高者,管理人才能收取附加管理费,附加管理费按照下述公式计算并收取。

提取评价日:每次基金封闭期的最后一个工作日

2）附加管理费的计算方法和提取

在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下,附加管理费的计算方法为

[illegible]

附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第3－8项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、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财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

基金管理人与基金托管人协商一致调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等费率,无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

13.2与基金销售有关的费用

1、本基金的申购费率最高不高于1.5%,且随申购金额的增加而递减,如下表所示

| 申购金额(M) | 申购费率 |
|---|---|
| M<100万 | 1.5% |
| 100万≤M<500万 | 0.9% |
| 500万≤M<1000万 | 0.3% |
| M≥1000万 | 每笔1,000元 |

投资人重复申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、本基金赎回费率最高不超过1.5%,随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示（其中1年指365天）:

| 申请份额持有时间(N) | 赎回费率 |
|---|---|
| N<7日 | 1.5% |
| 7日≤N<30日 | 0.75% |
| 30日≤N<1年 | 0.5% |
| 1年≤N<2年 | 0.3% |
| N≥2年 | 0 |

注:N为自然日。

对于开放期申购并在该开放期赎回的基金份额，由于开放期可能涵盖节假日或者周末，因此该份额的持有时间可能出现小于7日或者大于7日但是小于30日的情况,对应的赎回费率将按照上述安排收取。

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期小于7日的基金份额所收取的赎回费,赎回费用全额归入基金财产;对于持有期长于7日但少于30日的基金份额所收取的赎回费,赎回费用50%归入基金财产;对于持有期长于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用75%归入基金财产;对于持有期长于3个月但小于6个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用50%归入基金财产;对于持有期长于6个月的基金份额所收取的赎回费,赎回费用25%归入基金财产。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

4、基金管理人及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。

§14对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据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,更新了主要人员情况。

2、在“基金托管人”部分,对基金托管人情况进行了更新。

3、在“相关服务机构”部分,对代销银行、代销券商和其他代销机构名单进行了更新。

4、在“基金的募集”部分,更新了相关内容。

5、在“基金合同的生效”部分,更新了相关内容

6、在“基金份额的申购和赎回”,对申购赎回的开放期和封闭期、申购赎回的份额限制、基金转换、申购费用和赎回费用进行了更新。

7、在“基金的投资”部分,补充了本基金最近一期投资组合报告的内容和基金业绩。

8、在“基金份额持有人的服务”部分,对基金份额持有人的服务的相关内容进行了更新。

9、对“其他应披露的事项” 进行了更新。

南方基金管理有限公司
2015年7月11日

# 南方利达灵活配置混合型证券投资基金开放日常赎回业务的公告

公告送出日期:2015年7月11日

1公告基本信息

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 南方利达灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 南方利达 | |
| 基金主代码 | 001566 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015年7月8日 | |
| 基金管理人名称 | 南方基金管理有限公司 | |
| 基金托管人名称 | 北京银行股份有限公司 | |
| 基金登记机构名称 | 南方基金管理有限公司 | |
| 公告依据 | 《南方利达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《南方利达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》 | |
| 赎回起始日 | 2015年7月13日 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方利达A | 南方利达C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001566 | 001567 |
| 该分级基金是否开放赎回 | 是 | 是 |

2 日常赎回业务的办理时间

本基金自2015年7月13日起开放日常赎回业务。

投资人在开放日办理基金份额的赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券/期货交易市场,证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

3 日常赎回业务

3.1 赎回份额限制

1、本基金单笔赎回申请不低于1份,投资人全额赎回时不受上述限制。各销售机构在符合上述规定的前提下,可根据情况调高单笔最低赎回份额要求,具体以销售机构规定的为准,投资人需遵循销售机构的相关规定;

2、本基金不对投资人每个交易账户的最低基金份额余额进行限制;

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

3.2 赎回费率

1、本基金A类份额赎回费率最高不超过1.5%,随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示（其中1年指365天）:

| A类份额的赎回费率 | |
|---|---|
| 申请份额持有时间(N) | 赎回费率 |
| N<7日 | 1.5% |
| 7日≤N<30日 | 0.75% |
| 30日≤N<6个月 | 0.5% |
| N≥6个月 | 0 |

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回A类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回A类基金份额时收取。对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费,赎回费用全额归入基金财产;对于持有期长于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用75%归入基金财产;对于持有期长于3个月但小于6个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用50%归入基金财产。

2、本基金C类份额赎回费率最高不超过0.5%，随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示:

| C类份额的赎回费率 | |
|---|---|
| 申请份额持有时间(N) | 赎回费率 |
| N<30日 | 0.5% |
| N≥30日 | 0 |

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回C类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回C类基金份额时收取。对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

3.3 其他与赎回相关的事项

1、基金管理人应以交易时间结束前受理有效赎回申请的当天作为赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。赎回的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准;

2、赎回以份额申请,遵循“未知价”原则,即赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

3、赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

4、当日的赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

5、投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的赎回申请不成立。

投资人赎回申请成功后,基金管理人将在T＋7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

4 基金销售机构

4.1 直销机构

南方基金管理有限公司（其中C类份额仅在直销柜台销售）

4.2 代销机构

中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、北京农村商业银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、青岛银行股份有限公司、深圳农村商业银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、哈尔滨银行股份有限公司、乌鲁木齐市商业银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、威海市商业银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、光大证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、安信证券股份有限