

南方积极配置证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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7月18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。

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。

基金净值的过往表现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。

本报告所载的财务资料未经审计。

本基金报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方积极配置股票(LOF)
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1月14日
报告期末基金份额总额	776,740,449.34份
投资目标	本基金为积极配置型基金,通过利澳操作进行资产配置和行业配置,在行业选择、风格选择、资产配置和风险管理上,在此基础上选择个股,力争在控制风险的前提下获得良好的收益。
投资策略	本基金秉承“积极配置”的投资策略,通过利澳操作进行资产配置和行业配置,在行业选择、风格选择、资产配置和风险管理上,在此基础上选择个股,力争在控制风险的前提下获得良好的收益。在本基金中,配置分为一级配置、二级配置和三级配置,其一级配置是通过所选的行业配置,二级配置是通过所选的资产配置。
业绩比较基准	85%×上证综指+15%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险收益特征与股票型基金相似,但投资于股票的资产比例较低,因此证券投资基金的风险收益特征与股票型基金相似。
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

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 404,857,405.46

2.本期利润 340,846,394.74

3.期末平均基金份额本期利润 0.3069

4.期末基金资产净值 1,358,068,731.11

5.期末基金份额净值 1.7484

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损益。

2.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金份额的各类费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本基金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

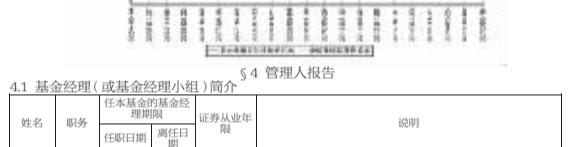
阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

过去三个月 21.17% 25.65% -11.20% 3.20% 0.70% 0.26%

3.2.2 本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

基金成立以来净值增长率与同期业绩基准收益率走势图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职本基金的年限	证券从业年限	说明
蔡景丽	基金经理	2015年1月	-	6年 清华大学固体力学专业硕士学历,具有基金从业资格,2008年4月起至2012年6月,任南方基金管理有限公司基金经理助理;2012年6月起至2013年1月,任南方基金管理有限公司基金经理;2013年1月起至今,任南方基金管理有限公司基金经理。具有基金从业资格,通过了基金从业资格考试。

注:1.对基金的前任基金经理,其“任职日期”为基金份额生效日,“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期,对此前的非前任基金经理,“任职日期”和“离职日期”分别为根据公司决定确定的任用日期和解聘日期。

2.基金管理人从行业协会从业人员从业资格管理办法的相关规定。

3.2.2 本基金报告期内不存在基金经理变动的情况。

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、中国证监会及中国基金业协会发布的基金合同的约定,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。本基金报告期内,基金管理人严格遵守法律法规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合相关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金监督管理办法》、《完善相

应制度》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售行为规范导则》等法律法规及公司制度的规定,在公平交易制度、交易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基金财产。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内不存在异常交易行为。

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、中国证监会及中国基金业协会发布的基金合同的约定,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。本基金报告期内,基金管理人严格遵守法律法规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合相关法律法规及基金合同的约定。

4.4 基金定期报告基金投资策略和运作分析

2季度本基金的市场表现经历了快速的应对,减仓了高估值的计算机、传媒等

行业公司,增加了金融、医药、食品饮料等行业的配置,从而降低了整体估值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本期基金净值上涨11.7%,沪深300指数上涨10.41%。

4.5 报告期内持有人数或基金份额净值预告说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	权证投资	1,028,098,180.5	67.34%
2	股票	1,028,098,180.5	67.34%
3	债券	12,819,570.40	0.94%
4	货币市场基金	12,819,570.40	0.94%
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	74,025,946.67	4.90%
7	其他资产	411,506,133.64	26.93%
8	合计	1,628,137,842.22	100.00%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 404,857,405.46

2.本期利润 340,846,394.74

3.期末平均基金份额本期利润 0.3069

4.期末基金资产净值 1,358,068,731.11

5.期末基金份额净值 1.7484

§ 6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额 1,078,076,422.64

报告期期初基金份额总额 306,564,163.20

报告期期间基金申购赎回情况(份额减少以“-”填列)

报告期期间基金申购赎回情况(份额减少以“-”填列)

报告期期末基金份额总额 776,740,449.34

注:本基金在交易所行情系统等其他信息披露场合下,可简称为“南方积极”。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:基金管理人运用固有资金投资其持有的基金份额。

注:基金管理人运用固有资金投资其持有的基金份额。