

## 南方策略优化股票型证券投资基金

[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。

基金托管人和基金管理人根据基金合同的规定，于2015年7月15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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自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:南方策略优化股票

交易代码:202019

前一交易日代码:202019

后一交易日代码:202020

基金运作方式:契约型开放式

定期开放式

报告期末基金份额总额:392,254,620.56份

投资目标:本基金通过量化手段优化投资组合，在把握宏观经济及相关行业景气趋势的前提下选择优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的稳定回报。

投资策略:本基金投资于股票资产，股票投资组合的资产配置比例为0%—100%。股票投资组合的行业配置比例为0%—100%。本基金通过量化手段优化投资组合，在把握宏观经济及相关行业景气趋势的前提下选择优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的稳定回报。

业绩比较基准:90%×沪深300指数+20%×上证国债指数

风险收益特征:本基金为股票基金，属于较高风险和较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于债券基金、债券基金及货币市场基金。

基金管理人:南方基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值揭示其他信息披露场合下，简称为“南方策略”。

§ 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

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 269,473,714.69

2.期初利润 133,045,444.69

3.加权平均基金份额本期利润 0.3230

4.期末基金份额净值 576,066,443.61

5.期末基金份额总额 1,507

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)和除利息收入后的余额，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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本期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 业绩比较基准收益率标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 28.04% 2.63% 8.86% 2.09% 19.18% 0.54%

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

注:本基金在交易所行情系统净值揭示其他信息披露场合下，简称为“南方策略”。

§ 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 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

杨德龙 基金经理 2013年3月15日 - 8年 北京大学经济学硕士，清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006年加入南方基金，历任研究部宏观研究员、首席宏观分析师，2010年3月至2013年4月，任南方策略优化股票型证券投资基金基金经理，2013年4月至今，任南方300股票型证券投资基金、2013年4月至今，任南方策略优化股票型证券投资基金基金经理，2013年4月至今，任南方开泰保本混合型证券投资基金基金经理，2014年4月至今，任南方开泰保本混合型证券投资基金基金经理，2014年4月至今，任南方开泰保本混合型证券投资基金基金经理。

5.11.1 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股库。

5.11.2 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 376,360.00

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 12,964.11

5 应收申购款 10,797,696.31

6 其他应收款 -

7 券商费用 -

8 其他 -

9 合计 11,187,001.32

5.11.3 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。

5.11.4 报告期末未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。

5.11.5 报告期末基金资产的流通受限情况

注:本基金本报告期末不存在流通受限情况。

5.11.6 报告期末基金资产的流动性受限情况

注:本基金本报告期末不存在流动性受限情况。

5.11.7 报告期末基金资产的组合情况

注:本基金本报告期末不存在基金资产的组合情况。

5.11.8 报告期末持有的股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.11.9 报告期末持有的债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.11.10 报告期末持有的贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.11.11 报告期末持有的其他投资明细

注:本基金本报告期末未持有其他投资。

5.11.12 报告期末持有的权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.11.13 报告期末持有的股指期货投资明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.11.14 报告期末持有的转融通证券明细

注:本基金本报告期末未持有转融通证券。

5.11.15 报告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。

5.11.16 报告期末基金组合的资产配置情况

注:本基金本报告期末基金组合的资产配置情况

5.11.17 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.18 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.19 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.20 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.21 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.22 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.23 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.24 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.25 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.26 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.27 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.28 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.29 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.30 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.31 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.32 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.33 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.34 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.35 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.36 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.37 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.38 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.39 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.40 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.41 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.42 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.43 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.44 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.45 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.46 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.47 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.48 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.49 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.50 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.51 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.52 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.53 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.54 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.55 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.56 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.57 报告期末持有的其他资产情况

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.58 报告期末持有的其他负债情况

注:本基金本报告期末未持有其他负债。

5.11.59 报告期末持有的其他资产情况