

基金管理人:南方基金基金管理有限公司
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

基金管理人及董事承诺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情况等内容,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,也不保证基金收益不低于某一水平,投资者投资于本基金时须自行承担投资风险。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的风险揭示书。

本报告财务资料未经审计。

本报告日期为2015年7月1日起至2015年9月30日止。

基金概况	
基金名称	南方优选价值混合
交易代码	202011
前次交易代码	202011
前次交易日期	202012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月18日
报告期末基金份额总额	487,773,546.49份
投资目标	
本基金为混合型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,采用自上而下选股的模式,投资于资产价值偏优、并且具备价值投资特征的上市公司股票,追求基金资产的长期、稳定增值。	
投资策略	
采用“自上而下”的策略,比较上市公司的现有账面资产价值与股价的偏离程度,在估值合理的前提下,选择具有良好成长性的个股进行投资,在估值合理的前提下,选择具有良好成长性的个股进行投资,在估值合理的前提下,选择具有良好成长性的个股进行投资。	
业绩比较基准	
80%×沪深300指数+20%×上证国债指数	
风险收益特征	
本基金为混合型基金,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、货币型基金。	
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

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“南方优选”。

3.1 主要财务指标		单位:人民币元				
报告期间(2015年7月1日 - 2015年9月30日)						
1.本期已实现收益		-41,406,117.58				
2.本期利润		-166,383,074.91				
3.加权平均基金份额本期利润		-0.3259				
4.期末基金资产净值		837,141,714.36				
5.期末基金份额净值		1.3161				
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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。						
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
过去三个月	-14.58%	3.56%	-22.77%	2.67%	8.21%	0.89%

注:本基金合同规定以某基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势对比图。



南方中债中期票据指数债券型发起式证券投资基金

2015 第三季度报告

基金管理人:南方基金基金管理有限公司
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

基金管理人及董事承诺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情况等,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,也不保证基金收益不低于某一水平,投资者投资于本基金时须自行承担投资风险。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的风险揭示书。

本报告财务资料未经审计。

本报告日期为2015年07月01日起至2015年09月30日止。

基金概况	
基金名称	南方中债中期票据指数债券型发起式
交易代码	000022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月13日
报告期末基金份额总额	62,180,334.68份
投资目标	本基金采取买入并持有的投资策略,投资于具有良好流动性的中期票据,追求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金为债券型基金,主要投资于中期票据,以获取稳定的利息收入,并追求基金资产的长期、稳定增值。本基金主要投资于具有良好流动性的中期票据,追求基金资产的长期、稳定增值。
业绩比较基准	中债-新综合债券指数收益率×95%+银行间存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币型基金。
基金管理人	南方基金基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基本情况	南方中债中期票据指数债券型发起式A
下属分级基金的交易代码	000022
报告期末下属分级基金的份额总额	61,718,734.76份

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.53%	0.06%	1.26%	0.06%	0.27%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.26%	0.00%	0.00%

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
过去三个月	1.52%	0.06%	1.26%	0.06%	0.2		