

南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金

[2015]第三季度报告

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10月27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根据本基金合同规定，于2015年10月22日核对了本基金的财务指标、净值表现和投资组合报告等，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。

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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方新兴消费增长分级股票
场内简称	南方消费
交易代码	160127
基金运作方式	上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年3月1日
报告期末基金份额总额	205,101,150份
投资目标	本基金主要投资于消费行业中的消费类企业，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将充分考虑行业属性，从宏观经济、经济环境、证券市场等方面对市场预期的系统性风险以及预期的未达到各投资品种的平均风险和预期风险进行分析判断，结合合理的定期调整资产配置比例，通过对股票、债券、现金等金融工具的配置，在保持总体风险水平相对稳定的前提下，力争实现资产的增值保值。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的证券投资基金品种。其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	南方新兴消费增长分级股票 南方消费进取 南方消费进取
下属分级基金的内部简称	南方消费 消费进取 消费进取
下属分级基金的交易代码	160127 150049 150050
报告期末下属分级基金的份额总额	142,606,203,050份 31,297,964,00份 31,297,964,00份
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“南方新兴消费”。	

§ 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7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-60,201,980.03
2.本期利润	-91,030,903.60
3.期末平均基金份额本期利润	-0.0406
4.期末基金资产净值	184,959,411.67
5.期末基金份额净值	0.902

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申购基金的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	差值(%)
过去三个月	-305.1%	3.47%	-20.10%	2.68% -10.41% 0.79%

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:本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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
蒋洁泓	本基金基金经理	2014年12月18日 - 7年		清华大学金融系工学硕士。2006年7月加入南方基金管理有限公司，历任基金客户服务部专员、基金销售部专员、基金研究部研究员、2014年3月至2014年12月，任南方基金管理有限公司基金经理助理；2014年12月至2015年7月，任南方基金管理有限公司基金经理；2015年7月至今，任南方基金管理有限公司基金经理。
肖勇	本基金基金经理	2015年7月24日 - 7年		复旦大学金融工程管理专业硕士，具有注册金融分析师(CFA)、中国证券业协会投资顾问、FRM、以及基金从业资格。2008年7月加入南方基金管理有限公司，历任基金研究部研究员、基金经理助理、基金经理、专营量化研究工作，任基金经理助理兼量化基金经理；2015年7月至今，任南方基金管理有限公司基金经理。

注:1.对基金的前任基金经理，其“任职日期”为“本基金合同生效日”，“离任日期”为根据公司决定确定的日期；对之后的非前任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指经公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员职业道德准则》的规定。

3.2.3 公平交易专项说明

3.2.3.1 公平交易执行的情况

本基金期内，基金经理严格遵守《证券投资基金法》以及其他法律法规和行业自律规则，不存在不公平对待旗下管理的不同基金的情况。

3.2.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金期内，基金经理严格执行《证券投资基金法》以及其他法律法规和行业自律规则，不存在不公平对待旗下管理的不同基金的情况。

3.2.3.3 公平交易执行的专项说明

本基金期内基金管理人未发生不公平对待旗下管理的其他基金的情况。

3.2.4 异常交易行为的专项说明

本基金期内，基金管理人未发生任何影响市场价格的异常交易行为。

3.2.5 本报告期内基金投资组合类资产的偏离度

本基金报告期内，基金资产组合类资产的偏离度未超过本基金合同规定的偏离度限制，且偏离度未超过0.5%，未超过0.5%的幅度。

3.2.6 本报告期内公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人公平交易制度的执行情况符合相关法律法规的规定。

3.2.7 本报告期内关联交易的专项说明

本基金报告期内，基金管理人未发生关联交易。

3.2.8 报告期内基金组合类资产的偏离度

本基金报告期内，基金资产组合类资产的偏离度未超过本基金合同规定的偏离度限制，且偏离度未超过0.5%，未超过0.5%的幅度。

3.2.9 本报告期内公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人公平交易制度的执行情况符合相关法律法规的规定。

3.2.10 本报告期内关联交易的专项说明

本基金报告期内，基金管理人未发生关联交易。

3.2.11 本报告期内公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人公平交易制度的执行情况符合相关法律法规的规定。

3.2.12 本报告期内关联交易的专项说明

本基金报告期内，基金管理人未发生关联交易。

3.2.13 本报告期内公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人公平交易制度的执行情况符合相关法律法规的规定。

3.2.14 本报告期内持有的处于待股期的可转换债券明细

注:本基金报告期内未持有处于待股期的可转换债券。

3.2.15 报告期内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 流通受限原因 占基金资产净值比例(%)

1 002014 新钢股份 未知 0.86%

2 002235 安彩高科 未知 0.26%

3 合计 1.12%

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末不存在按债券品种分类的债券投资组合。

5.5 报告期内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 代码 名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601360 中国远洋 1,000,000.00 0.00%

2 600036 招商银行 999,999.00 0.00%

3 600030 中国平安 999,999.00 0.00%

4 600031 中国人寿 999,999.00 0.00%

5 600032 中国人保 999,999.00 0.00%

6 600033 中国太保 999,999.00 0.00%

7 600034 中国人保财险 999,999.00 0.00%

8 600035 中国人寿保险 999,999.00 0.00%

9 600036 中国人寿保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

10 600037 中国人寿财产保险有限公司 999,999.00 0.00%

11 600038 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

12 600039 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

13 600040 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

14 600041 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

15 600042 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

16 600043 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

17 600044 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

18 600045 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

19 600046 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

20 600047 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

21 600048 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

22 600049 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

23 600050 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

24 600051 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

25 600052 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

26 600053 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

27 600054 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

28 600055 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

29 600056 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

30 600057 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

31 600058 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

32 600059 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

33 600060 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

34 600061 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

35 600062 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%

36 600063 中国人寿财产保险股份有限公司 999,999.00 0.00%