

## 中国梦灵活配置混合型证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

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:2016年1月21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，并对其内容的真性、准确性、完整性和及时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2016年1月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称:中国梦灵活配置混合

交易代码:000664

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2014年9月6日

报告期末基金的总资产:228,690,026.08元

以上市公司基本面研究作为基础，通过专业化研究分析，积极挖掘成长性行业中的投资机会，精选个股，精选行业，精选个股，通过精选个股，追求超越业绩比较基准的投资回报。

投资目标:本基金通过深入分析和精选个股的分析，选择经济周期内具有投资价值的行业和个股，通过精选个股，精选行业，精选个股，通过精选个股，追求超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略:本基金将坚持长期投资原则与不定期的资产配置调整原则，适时地对基金的资产配置进行调整。此外，本基金将坚持长期投资原则与不定期的资产配置调整原则，适时地对基金的资产配置进行调整。

业绩比较基准:沪深300指数收益率\*60%+上证国债收益率\*40%

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率高于股票型基金，低于债券型基金，风险收益特征属中等。

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

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“中国梦基金”。

## §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

报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期三四季度收益:12,669,431.46

2.本期利润:76,443,544.98

3.加权平均基金份额本期利润:0.2946

4.期末基金份额净值:373,467,937.62

5.期末基金份额净值:1.5665

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 基金净值表现

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 ①-③ ②-④

过去三个月 21.98% 1.90% 10.06% 1.01% 11.33% 0.98%

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

基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比如图

注:本基金建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4.4 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限 证券从业年限 说明

蔡鹏程 本基金基金经理 7/24日 - 7年

注:本基金基金经理严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,中国证监会和《中国梦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金运作整体严格控制风险,投资比例符合有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,基金管理人严格执行《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过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所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价,在同时间段内买入或卖出成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的公平交易和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资组合运作分析

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

4.5 报告期内基金净值增长率表现

4.5.1 报告期内基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 327,150,676.55 87.21

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 10,012,000.00 2.67

4 货币市场基金 - -

5 银行存款和结算备付金账户 37,169,000.00 9.30

6 其他资产 38,956,679.83 0.98

7 银行存款和结算备付金合计 376,606,183.34 100.00

8 其他资产 1,136,848.96 0.30

9 合计 376,606,183.34 100.00

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“500信息ETF”。

## §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

报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期三四季度收益:1,539,001.86

2.本期利润:19,320,612.30

3.加权平均基金份额本期利润:0.3703

4.期末基金份额净值:38,956,256.86

5.期末基金份额净值:1.0475

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 ①-③ ②-④

过去三个月 35.28% 2.38% 36.70% 2.38% -1.42% 0.00%

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

基金合同对本基金的定期报告期止点的约定

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“500信息ETF”。

## §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限 证券从业年限 说明

蔡鹏程 本基金基金经理 7/24日 - 7年

注:本基金基金经理严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,中国证监会和《中国梦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金运作整体严格控制风险,投资比例符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.1 管理人对本基金运作的公平性说明

4.2.2 管理人对本基金运作的合规性说明

4.2.3 管理人对本基金运作的规范性说明

4.3 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

4.3.1 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

4.3.2 管理人对本基金投资组合的业绩表现说明

4.4 报告期内基金的公平交易和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资组合运作分析

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

4.5 报告期内基金净值增长率表现

4.5.1 报告期内基金资产组合报告

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 327,150,676.55 87.21

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 10,012,000.00 2.67

4 货币市场基金 - -

5 银行存款和结算备付金账户 37,169,000.00 9.30

6 其他资产 38,956,679.83 0.98

7 银行存款和结算备付金合计 376,606,183.34 100.00

8 其他资产 1,136,848.96 0.30

9 合计 376,606,183.34 100.00

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“500信息ETF”。

## §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

报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期三四季度收益:1,539,001.86

2.本期利润:19,320,612.30

3.加权平均基金份额本期利润:0.3703

4.期末基金份额净值:38,956,256.86

5.期末基金份额净值:1.0475

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 ①-③ ②-④

过去三个月 35.28% 2.38% 36.70% 2.38% -1.42% 0.00%

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

基金合同对本基金的定期报告期止点的约定

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“500信息ETF”。

## §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限 证券从业年限 说明

蔡鹏程 本基金基金经理 7/24日 - 7年

注:本基金基金经理严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,中国证监会和《中国梦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内,基金运作整体严格控制风险,投资比例符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2.1 管理人对本基金运作的公平性说明

4.2.2 管理人对本基金运作的合规性说明

4.2.3 管理人对本基金运作的规范性说明

4.3 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

4.3.1 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

4.3.2 管理人对本基金投资组合的业绩表现说明

4.4 报告期内基金的公平交易和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资组合运作分析

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

4.5 报告期内基金净值增长率表现

4.5.1 报告期内基金资产组合报告

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 327,150,676.55 87.21

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 10,012,000.00 2.67

4 货币市场基金 - -

5 银行存款和结算备付金账户 37,169,000.00 9.30

6 其他资产 38,956,679.83 0.98

7 银行存款和结算备付金合计 376,606,183.34