

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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的规定,履行其职责。基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的规定,履行其职责。基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当勤勉尽责,严格按照法律法规及基金合同的规定,履行其职责。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中国梦灵活配置混合 |
| 交易代码 | 000954 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年6月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 238,680,029.69份 |
| 投资目标 | 以上市公司基本面研究为基础,通过专业化研究分析,积极控制或选择性行业和企业所面临的投资风险,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法,对宏观经济和证券市场发展趋势,证券市场系统性风险和个股基本面进行判断,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×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 | 南方基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

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

| 主要财务指标 | 报告期(2015年10月1日至2015年12月31日) |
|----------------|-----------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 12,669,431.46 |
| 2.本期利润 | 76,443,544.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2946 |
| 4.期末基金净值 | 373,407,307.52 |
| 5.期末基金净值增长率 | 1.56% |

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% | 10.05% | 1.01% | 11.33% | 0.89% |

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:本基金建仓期为六个月,建仓期结束后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限 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------|-------------|--------|---|
| 蔡明 | 本基金基金经理 | 2015年7月24日 | 7年 | 清华大学工学硕士,具有基金从业资格,2008年4月加入南方基金,曾任南方基金信息技术部副经理,2015年12月加入南方基金,现任南方基金信息技术部副经理,2015年12月加入南方基金,现任南方基金信息技术部副经理,2015年12月加入南方基金,现任南方基金信息技术部副经理。 |

4.2 管理人及基金经理承诺

在本报告期内,本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,中国证监会和《中国梦灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,运用专业管理,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,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
本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人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

本基金在本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,未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
4.4.2 报告期内基金业绩表现说明
4.4.3 报告期内基金业绩表现说明

4.4.4 报告期内基金业绩表现说明

4.4.5 报告期内基金业绩表现说明

4.4.6 报告期内基金业绩表现说明

4.4.7 报告期内基金业绩表现说明

4.4.8 报告期内基金业绩表现说明

4.4.9 报告期内基金业绩表现说明

4.4.10 报告期内基金业绩表现说明

4.4.11 报告期内基金业绩表现说明

4.4.12 报告期内基金业绩表现说明

4.4.13 报告期内基金业绩表现说明

4.4.14 报告期内基金业绩表现说明

4.4.15 报告期内基金业绩表现说明

4.4.16 报告期内基金业绩表现说明

4.4.17 报告期内基金业绩表现说明

4.4.18 报告期内基金业绩表现说明

4.4.19 报告期内基金业绩表现说明

4.4.20 报告期内基金业绩表现说明

4.4.21 报告期内基金业绩表现说明

4.4.22 报告期内基金业绩表现说明

4.4.23 报告期内基金业绩表现说明

4.4.24 报告期内基金业绩表现说明

4.4.25 报告期内基金业绩表现说明

4.4.26 报告期内基金业绩表现说明

4.4.27 报告期内基金业绩表现说明

4.4.28 报告期内基金业绩表现说明

4.4.29 报告期内基金业绩表现说明

4.4.30 报告期内基金业绩表现说明

4.4.31 报告期内基金业绩表现说明

4.4.32 报告期内基金业绩表现说明

4.4.33 报告期内基金业绩表现说明

4.4.34 报告期内基金业绩表现说明

4.4.35 报告期内基金业绩表现说明

4.4.36 报告期内基金业绩表现说明

4.4.37 报告期内基金业绩表现说明

4.4.38 报告期内基金业绩表现说明

4.4.39 报告期内基金业绩表现说明

4.4.40 报告期内基金业绩表现说明

4.4.41 报告期内基金业绩表现说明

4.4.42 报告期内基金业绩表现说明

4.4.43 报告期内基金业绩表现说明

4.4.44 报告期内基金业绩表现说明

4.4.45 报告期内基金业绩表现说明

4.4.46 报告期内基金业绩表现说明

4.4.47 报告期内基金业绩表现说明

4.4.48 报告期内基金业绩表现说明

4.4.49 报告期内基金业绩表现说明

4.4.50 报告期内基金业绩表现说明

4.4.51 报告期内基金业绩表现说明

4.4.52 报告期内基金业绩表现说明

4.4.53 报告期内基金业绩表现说明

4.4.54 报告期内基金业绩表现说明

4.4.55 报告期内基金业绩表现说明

4.4.56 报告期内基金业绩表现说明

4.4.57 报告期内基金业绩表现说明

4.4.58 报告期内基金业绩表现说明

4.4.59 报告期内基金业绩表现说明

4.4.60 报告期内基金业绩表现说明

4.4.61 报告期内基金业绩表现说明

4.4.62 报告期内基金业绩表现说明

4.4.63 报告期内基金业绩表现说明

4.4.64 报告期内基金业绩表现说明

4.4.65 报告期内基金业绩表现说明

4.4.66 报告期内基金业绩表现说明

4.4.67 报告期内基金业绩表现说明

4.4.68 报告期内基金业绩表现说明

4.4.69 报告期内基金业绩表现说明

4.4.70 报告期内基金业绩表现说明

4.4.71 报告期内基金业绩表现说明

4.4.72 报告期内基金业绩表现说明

4.4.73 报告期内基金业绩表现说明

4.4.74 报告期内基金业绩表现说明

4.4.75 报告期内基金业绩表现说明

4.4.76 报告期内基金业绩表现说明

4.4.77 报告期内基金业绩表现说明

4.4.78 报告期内基金业绩表现说明

4.4.79 报告期内基金业绩表现说明

4.4.80 报告期内基金业绩表现说明

4.4.81 报告期内基金业绩表现说明

4.4.82 报告期内基金业绩表现说明

4.4.83 报告期内基金业绩表现说明

4.4.84 报告期内基金业绩表现说明

4.4.85 报告期内基金业绩表现说明

4.4.86 报告期内基金业绩表现说明

4.4.87 报告期内基金业绩表现说明

4.4.88 报告期内基金业绩表现说明

4.4.89 报告期内基金业绩表现说明

4.4.90 报告期内基金业绩表现说明

4.4.91 报告期内基金业绩表现说明

4.4.92 报告期内基金业绩表现说明

4.4.93 报告期内基金业绩表现说明

4.4.94 报告期内基金业绩表现说明

4.4.95 报告期内基金业绩表现说明

4.4.96 报告期内基金业绩表现说明

4.4.97 报告期内基金业绩表现说明

4.4.98 报告期内基金业绩表现说明

4.4.99 报告期内基金业绩表现说明

4.4.100 报告期内基金业绩表现说明

4.4.101 报告期内基金业绩表现说明

4.4.102 报告期内基金业绩表现说明

4.4.103 报告期内基金业绩表现说明

4.4.104 报告期内基金业绩表现说明

4.4.105 报告期内基金业绩表现说明

4.4.106 报告期内基金业绩表现说明

4.4.107 报告期内基金业绩表现说明

4.4.108 报告期内基金业绩表现说明

4.4.109 报告期内基金业绩表现说明

4.4.110 报告期内基金业绩表现说明

4.4.111 报告期内基金业绩表现说明

4.4.112 报告期内基金业绩表现说明

4.4.113 报告期内基金业绩表现说明

4.4.114 报告期内基金业绩表现说明

4.4.115 报告期内基金业绩表现说明

4.4.116 报告期内基金业绩表现说明

4.4.117 报告期内基金业绩表现说明

4.4.118 报告期内基金业绩表现说明

4.4.119 报告期内基金业绩表现说明

4.4.120 报告期内基金业绩表现说明

4.4.121 报告期内基金业绩表现说明

4.4.122 报告期内基金业绩表现说明

4.4.123 报告期内基金业绩表现说明

4.4.124 报告期内基金业绩表现说明

4.4.125 报告期内基金业绩表现说明

4.4.126 报告期内基金业绩表现说明

4.4.127 报告期内基金业绩表现说明

4.4.128 报告期内基金业绩表现说明

4.4.129 报告期内基金业绩表现说明

4.4.130 报告期内基金业绩表现说明

4.4.131 报告期内基金业绩表现说明

4.4.132 报告期内基金业绩表现说明

4.4.133 报告期内基金业绩表现说明

4.4.134 报告期内基金业绩表现说明

4.4.135 报告期内基金业绩表现说明

4.4.136 报告期内基金业绩表现说明

4.4.137 报告期内基金业绩表现说明

4.4.138 报告期内基金业绩表现说明

4.4.139 报告期内基金业绩表现说明

4.4.140 报告期内基金业绩表现说明

4.4.141 报告期内基金业绩表现说明

4.4.142 报告期内基金业绩表现说明

4.4.143 报告期内基金业绩表现说明

4.4.144 报告期内基金业绩表现说明

4.4.145 报告期内基金业绩表现说明

4.4.146 报告期内基金业绩表现说明

4.4.147 报告期内基金业绩表现说明

4.4.148 报告期内基金业绩表现说明

4.4.149 报告期内基金业绩表现说明

4.4.150 报告期内基金业绩表现说明

4.4.151 报告期内基金业绩表现说明

4.4.152 报告期内基金业绩表现说明

4.4.153 报告期内基金业绩表现说明

4.4.154 报告期内基金业绩表现说明

4.4.155 报告期内基金业绩表现说明

4.4.156 报告期内基金业绩表现说明

4.4.157 报告期内基金业绩表现说明

4.4.158 报告期内基金业绩表现说明

4.4.159 报告期内基金业绩表现说明

4.4.160 报告期内基金业绩表现说明

4.4.161 报告期内基金业绩表现说明

4.4.162 报告期内基金业绩表现说明

4.4.163 报告期内基金业绩表现说明

4.4.164 报告期内基金业绩表现说明

4.4.165 报告期内基金业绩表现说明

4.4.166 报告期内基金业绩表现说明

4.4.167 报告期内基金业绩表现说明

4.4.168 报告期内基金业绩表现说明

4.4.169 报告期内基金业绩表现说明

4.4.170 报告期内基金业绩表现说明

4.4.171 报告期内基金业绩表现说明

4.4.172 报告期内基金业绩表现说明

4.4.173 报告期内基金业绩表现说明

4.4.174 报告期内基金业绩表现说明

4.4.175 报告期内基金业绩表现说明

4.4.176 报告期内基金业绩表现说明

4.4.177 报告期内基金业绩表现说明

4.4.178 报告期内基金业绩表现说明

4.4.179 报告期内基金业绩表现说明

4.4.180 报告期内基金业绩表现说明

4.4.181 报告期内基金业绩表现说明

4.4.182 报告期内基金业绩表现说明

4.4.183 报告期内基金业绩表现说明

4.4.184 报告期内基金业绩表现说明

4.4.185 报告期内基金业绩表现说明

4.4.186 报告期内基金业绩表现说明

4.4.187 报告期内基金业绩表现说明

4.4.188 报告期内基金业绩表现说明

4.4.189 报告期内基金业绩表现说明

4.4.190 报告期内基金业绩表现说明

4.4.191 报告期内基金业绩表现说明

4.4.192 报告期内基金业绩表现说明

4.4.193 报告期内基金业绩表现说明

4.4.194 报告期内基金业绩表现说明

4.4.195 报告期内基金业绩表现说明

4.4.196 报告期内基金业绩表现说明

4.4.197 报告期内基金业绩表现说明

4.4.198 报告期内基金业绩表现说明

4.4.199 报告期内基金业绩表现说明

4.4.200 报告期内基金业绩表现说明

4.4.201 报告期内基金业绩表现说明

4.4.202 报告期内基金业绩表现说明

4.4.203 报告期内基金业绩表现说明

4.4.204 报告期内基金业绩表现说明