

信息披露 Disclosure

南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金

[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

报告送达日期: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的规定，于2016年1月19日复核了本报告中的财务数据、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。

本报告中财务数据未经审计。

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	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	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年3月11日
报告期末基金份额总额	196,810,304.75份
投资目标	通过深入研究我们对经济结构转型阶段和长期发展趋势，选择具备新兴消费增长潜力的上市公司进行投资，追求基金的长期增长。
投资策略	本基金的投资策略分析如下：从宏观政策、经济环境、证券市场走势等方面分析市场的系统性风险以及预期的未来时间内的各类资产的相对收益，通过分析，确定各资产的配置，在保持总体风险水平和对稳定的前提下，力争获得资产的长期增值。
业绩比较基准	中小企业板指数*80%+上证国债指数*20%
风险收益特征	本基金是一只具有较高风险、较高收益的股票型基金，适合风险承受能力较强的投资者。
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
南方消费收益	南方消费收益
下属分级基金的交易代码	160127 150009
报告期末下属分级基金的份额总额	146,999,016.76份 26,405,647.00份
报告期末下属分级基金的单位净值	2.03 2.05

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“南方消费”。

§ 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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-7,891,370.03
2.本期利润	62,889,240.12
3.期初至报告期利润累计金额	0.2038
4.期末基金净值	234,729,339.06
5.期末基金资产净值	1.093

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,计算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 报告期内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	32.26%	1.09%	12.11%	1.30%	19.86%	0.05%

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

南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金2015年第4季度报告

注:本基金合同生效日为基金首任基金经理“任晓洁”的任职日期,即2015年1月10日,报告期公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理“任晓洁”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

5.4 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

蒋秋洁 本基金基金经理 2014年12月10日 - 7年 7年 南开大学光电子工程硕士,2008年7月加入南方基金管理有限公司,负责通信与电子行业研究,2014年3月至2015年1月任南方新兴产业基金经理;2015年1月至今,任南方消费基金经理;2015年12月至今,任南方消费增长基金经理;2016年1月至今,任南方消费进取基金经理。

肖勇 本基金基金经理 2016年7月24日 - 7年 复旦大学工商管理硕士,具有证券分析与评估经验,2008年7月加入南方基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务,2015年7月至今,任南方消费基金经理;2016年7月至今,任南方消费增长基金经理;2016年8月至今,任南方消费进取基金经理。

注:1.本基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本报告期内,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、中国证监会公告和南方新兴消费增长分级股票型证券投资基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易原则的执行情况

本报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度流程,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。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5%的情况。

4.4 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.1 报告期内基金管理人公平交易情况

报告期内基金管理人公平交易情况不存在违反法律法规、行业监管规定和公司内部制度的情形。

4.4.2 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.3 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.4 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.5 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.6 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.7 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.8 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.9 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.10 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.11 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.12 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.13 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.14 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.15 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.16 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.17 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.18 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.19 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.20 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.21 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.22 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.23 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.24 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.25 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.26 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.27 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.28 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.29 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.30 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.31 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.32 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.33 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.34 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.35 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.36 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.37 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.38 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.39 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.40 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.41 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.42 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.43 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.44 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.45 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.46 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.47 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.48 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.49 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.50 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.51 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.52 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.53 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.54 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.55 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.56 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.57 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.58 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.59 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.60 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.61 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.62 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.63 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.64 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.65 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.66 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.67 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.68 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.69 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.70 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.71 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.72 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.73 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.74 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.75 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.76 报告期内基金管理人公平交易情况

4.4.77 报告期内基金管理人公平交易情况