

南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

[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:中国建设银行股份有限公司
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监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设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、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。

本报告附录财务数据未审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 南方绝对收益策略混合基金

基金代码 000844

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2014年1月21日

报告期末基金份额总额 856,584,034.08份

报告期末基金资产净值 1,000,000.00元

报告期末基金份额净值 1.1540元

报告目标 通过多策略的投资策略对冲本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳定增值

投资策略 本基金将通过主动择时、仓位控制、品种配置、行业轮动、债券等投资工具和比例，本基金将主要采用市场中的投资策略，通过定性和定量相结合的方法精选个股，并通过卖出股指期货合约对冲系统性风险，从而构造相对基准的一致的综合型基金策略和风险较小，而同时其波动率比股票低，由于吸收避险保值策略的不确定因素，本基金将综合考虑量化和基本面的风险。

基金经理人 南方基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后，可简称为“南方绝对收益”。

§ 3 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 -36,156.06

2.本期利润 4,260,380.32

3.期末基金资产净值余额 940,134,370.10

4.期末基金份额净值 1.1540

5.期末基金资产总值 940,134,370.10

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损益。

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(%) 净值增长标准差 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.46% 0.03% 0.07% 0.01% -0.42% 0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图示:南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金成立以来至2015年12月31日的净值增长率与业绩比较基准的走势图。

注:本基金建仓期为六个月，建仓期结束时各项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

朱卫华 本基金基金经理 2014年1月21日 - 6年 深华大学土木工程系本科毕业,清华大学力学系硕士,具有基金从业资格,2000年2月加入南方基金管理有限公司量化投资部高级研究员,2014年4月至2015年1月任南方基金管理有限公司量化投资部总监,2015年1月至今,任南方绝对收益基金经理。

注:1.对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;对此后的新任基金经理,“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.证券从业的含义是指从行业协会(或中国人民银行)获得的证券从业资格。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规守信情况的说明

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、中国证监会和《南方绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金》的有关规定,诚实守信、勤勉尽责地履行职责和运用基金资产,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的行为,基金投资运作合规、投资比例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 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金管理办法》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5%的情况。

4.4 报告期内基金的绩效评价和风险提示

4.4.1 报告期内基金的绩效评价

本基金报告期内不存在申购赎回情况。

4.4.2 风险提示

本基金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5%的情况。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 30,542,391.34 3.24

其中:股票 30,542,391.34 3.24

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

4 货币市场基金 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 其他投资 - -

其中:深股通股票型的买入返售金融资产 - -

7 银行存款和结算备付金合计 903,320,891.40 96.93

8 其他资产 7,776,237.87 0.83

9 合计 941,711,520.61 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

注:本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.1 本基金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 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.841% 0.007% 0.346% 0.0000% 0.490% 0.0000% 0.0070%

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.915% 0.007% 0.346% 0.0000% 0.569% 0.0000% 0.0070%

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.962% 0.007% 0.346% 0.0000% 0.510% 0.0000% 0.0070%

注:1.本基金每日以货币资金形态持有的资产,其当期收益按当日账面余额计算。

2.本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.2 本基金基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.3 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.46% 0.03% 0.07% 0.01% -0.42% 0.02%

注:1.本基金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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期利润。

2.本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.4 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.46% 0.03% 0.07% 0.01% -0.42% 0.02%

注:1.本基金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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期利润。

2.本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.5 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.46% 0.03% 0.07% 0.01% -0.42% 0.02%

注:1.本基金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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期利润。

2.本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.6 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.46% 0.03% 0.07% 0.01% -0.42% 0.02%

注:1.本基金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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期利润。

2.本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.7 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.46% 0.03% 0.07% 0.01% -0.42% 0.02%

注:1.本基金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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期利润。

2.本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.8 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.46% 0.03% 0.07% 0.01% -0.42% 0.02%

注:1.本基金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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期利润。

2.本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.9 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标准差(%) ① ③ ② - ④

过去三个月 0.46% 0.03% 0.07% 0.01% -0.42% 0.02%

注:1.本基金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损益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益即为本期利润。

2.本基金在交易所行情系统净值显示等其他信息被披露场外后,可简称为“南方绝对收益”。

3.2.10 本基金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(%) 净值增长率标准差(%) 业经审计收益 业经审计收益 标