

南方高端装备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12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 南方高端装备灵活配置混合

交易代码 203027

份额交易代码 203027

赎回交易代码 203028

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2014年1月24日

报告期末基金份额总额 384,999,672.90份

投资目标 本基金主要投资高端装备证券，在严格控制风险的前提下追求超越业绩比较基准的回报。

投资策略 在大类资产配置策略上，本基金将主要考虑：

(1) 资产配置比例，包括ESG、增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等；

(2) 财政经济指标，包括宏观经济主要指标的盈利变化情况及盈利预期等；

(3) 场景分析，包括股票市场与债券市场的波动率及预期收益率、市场情绪估值水平、股票与债券的性价比等；

(4) 政策预期，包括财政政策、货币政策、产业政策及其与证券市场密切相关的各种政策。

本基金将上述研究、分析市场风险对投资决策，及时确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等资产类别间的分布比例，有效管理投资风险，提高基金收益。

业绩比较基准 80%上证国债指数+20%股票型基金

风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期平均风险和预期收益率位于股票型基金，高于债券型基金。

基金管理人 南方基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

注:1.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“南方高端装备”。

2.本基金转型日期为2014年1月24日,该日起原南方金领油股票型证券投资基金正式变更为南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金。

§ 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10月1日 - 2015年12月31日)

1.本期实现收益 818,064.31

2.本期利润 115,639,890.61

3.本期平均基金份额本期利润 0.2764

4.期末未分配利润 561,922,922.02

5.期末基金份额净值 1.152

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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

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(%) 业绩比较基准收益率(%) ① - ③ ② - ④

过去三个月 20.40% 1.01% 19.01% 1.73% 10.47% 0.19%

3.2.2 本基金转型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

单位:人民币元

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 内本基金净值比例(%)

1 600017 黄河凤凰 1,127,628 28,540,264.00 4.00

2 300207 丽珠达 999,006 28,096,765.00 4.03

3 300017 网宿科技 437,347 26,236,445.00 4.51

4 002119 中航光电 572,500 21,735,100.00 3.73

5 300038 麦晶 323,000 18,307,640.00 3.15

6 600018 中航国际 397,300 16,901,142.00 2.90

7 002101 广东东能 601,374 16,546,342.00 2.84

8 300232 洲明科技 412,569 16,143,433.67 2.77

9 300006 南都电源 779,549 15,466,252.16 2.66

10 000951 中国国航 846,700 15,326,270.00 2.63

5.4 报告期末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

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.10 本基金投资股指期货的说明

5.11 报告期末本基金持有的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.12 本基金投资股票期权的说明

本基金在进行股票期权投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过与证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的套利模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过头寸或空头套期保值策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股票现货的流动性、波动性和风险特征，运用股指期货对冲系统性风险，对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回时，利用衍生品衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.13 报告期末本基金的国债期货交易情况说明

5.14 报告期末本基金的股指期货交易情况说明

5.15 报告期末前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.16 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 有价证券 974,143.04

2 应收股利

3 应收利息 31,565.66

4 应收申购款 194,104.64

5 其他应收款

6 待摊费用

7 其他

8 合计 1,199,903.14

5.17.1.1 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。

5.17.1.2 报告期末前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.17.1.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 有价证券 8,018,442.66

2 应收股利 44,271,330.01

3 应收利息 112,237,052.23

4 应收申购款 8,018,442.66

5 其他应收款 2,028.00

6 存放同业

7 其他

8 合计 384,969,739.11

5.17.2.1 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17.2.2 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.17.2.3 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.17.2.4 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.17.2.5 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.17.2.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票期权投资明细

本基金本报告期末未持有股票期权。

5.17.2.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期权投资明细

本基金本报告期末未持有股指期权。

5.17.2.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期权投资明细

本基金本报告期末未持有国债期权。

5.17.2.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票掉期投资明细

本基金本报告期末未持有股票掉期。

5.17.2.10 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债掉期投资明细

本基金本报告期末未持有国债掉期。

5.17.2.11 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票借贷投资明细

本基金本报告期末未持有股票借贷。

5.17.2.12 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债借贷投资明细

本基金本报告期末未持有国债借贷。

5.17.2.13 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票质押回购投资明细

本基金本报告期末未持有股票质押回购。

5.17.2.14 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债质押回购投资明细

本基金本报告期末未持有国债质押回购。

5.17.2.15 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票定期存款投资明细

本基金本报告期末未持有股票定期存款。

5.17.2.16 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债定期存款投资明细

本基金本报告期末未持有国债定期存款。

5.17.2.17 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17.2.18 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.17.2.19 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.17.2.20 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期权投资明细

本基金本报告期末未持有股指期权。

5.17.2.21 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期权投资明细</p