南方成份精选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	南方成份精选混合
交易代码	202005
前端交易代码	202005
后端交易代码	202006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年5月14日
报告期末基金份额总额	3,358,520,126.19份
投资目标	本基金在保持公司一贯投资理念基础上,通过对宏观经济和上市公司基本面的深入研究,采取定量和定性相结合方法,精选成份股,寻找驱动力型的领先上市公司,在控制风险的前提下追求获取超额收益。
投资策略	本基金在保持公司一贯投资理念的基础上,紧密把握和跟踪中国宏观经济周期、行业增长周期和企业成长周期,通过对行业的深入分析和上市公司基本面的研究,主要投资两类企业:1、驱动力型增长行业:通过对中国宏观经济的把握,根据对上下游行业运行态势与利益分配等因素的观察,考量行业增长周期,以确定对国民经济起主要驱动作用或作出重大贡献的行业/产业,从中优选代表性企业重点投资。2、行业领先型成长企业:强调处于企业成长生命周期的上升期,或面临重大的发展机遇,具备超常规增长潜力的上市公司。通过投资此两类公司,进而为本基金获取中长期稳健的资产增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
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水平低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。
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: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"南方成份"。

§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	259,136,631.68
2.本期利润	589,300,640.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.1785
4.期末基金资产净值	4,464,730,371.84
5.期末基金份额净值	1.3294

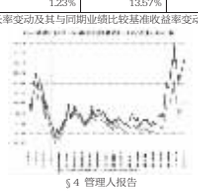
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。 2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	15.57%	1.23%	13.57%	1.34%	2.00%	-0.11%

3.2.2 自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



§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
		任职日期	离任日期		
陈键	本基金基金经理、投资部总监	2010年10月16日	-	15年	硕士学历,具有基金从业资格。2000年加入南方基金,历任行业研究员、基金经理助理、投资部执行总监,2014年12月至今,担任投资部总监。2003年11月-2005年6月,任南方宝元基金经理;2004年3月-2005年3月,任南方现金基金经理;2005年3月-2006年3月,任南方积配基金经理;2008年2月至2010年10月,任南方盛元基金经理;2006年3月至2014年7月,任天元基金经理;2010年10月至今,任南方成份基金经理;2012年12月至今,任南方安心基金经理;2015年5月至今,任南方改革机遇基金经理。
张原	本基金基金经理	2015年12月30日	-	9年	美国密歇根大学经济学硕士学位,具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金,曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员,南方高增及南方隆元基金经理助理;2015年4月至今,任投资部副总监;2009年9月至2013年4月,任南方500基金经理;2010年2月至今,任南方绩优基金经理;2011年2月至今,任南方高增基金经理;2015年12月至今,任南方成份基金经理。
黄春逢	本基金基金经理	2015年12月30日	-	4年	上海交通大学金融学硕士,具有基金从业资格。2011年7月至2014年12月,任职于国泰君安研究所,担任银行业分析师;2015年1月加入南方基金研究部,任金融行业高级研究员;2015年4月至2015年12月,任南方避险、南方保本、南方利海的基金经理助理;2015年5月至2015年12月,任南方利鑫的基金经理助理;2015年6月至2015年12月,任南方丰合的基金经理助理;2015年12月至今,任南方成份基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《南方成份精选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 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

四季度内,基金组的整体操作策略坚持理性投资、价值投资、顺应趋势的理念,在资产配置上采取相对防御的策略,通过行业配置和个股选择来努力创造超额收益。结合宏观层面稳定房地产消费、汽车消费、鼓励创业等具体政策不断出台,基建投资、一带一路等有利于经济企稳的政策规划也不断更新,组合持有的一些行业龙头优质公司表现超越了指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

四季度内,沪深300指数上升16.5%,南方成份精选基金期间净值上升约15.57%,考虑仓位因素后,基金业绩表现略微超越业绩基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段,除美国外其他全球经济体仍无明显复苏迹象,中国经济也仍处于下行通道。随着美联储本轮首次加息落地,人民币阶段性贬值压力将继续存在,从而对国内货币政策进一步大幅宽松的空间造成挤压。但可以预见的是,央行仍将通过多种途径向市场注入流动性以维持流动性的充裕,财政政策也将持续发力以确保宏观经济运行在底线之上。

在16年四季度市场信心修复的过程中,许多股票短期内估值大幅上升并积累了一定的估值泡沫。由于上市公司整体盈利增速远不及估值的提升速度,市场短期来看难以寻找到真正的价值洼地,单纯依靠估值向上提升的空间已经非常有限,更多的投资机会可能需要适度的风险释放。在风格上,由于市场利率中枢持续下行,以保险资管和银行理财资金为代表的低风险偏好资金面临一定的再投资压力,未来提升权益类资产占比将是大势所趋,因此我们预计下一阶段市场的投资者结构及整体风格也将趋于均衡。

基于此,一方面我们将适度调低股票仓位,努力回避市场风险释放过程中带来的净值波动风险;另一方面在配置上也会趋于均衡,低估值高分红的价值股以及拥有核心竞争优势的白马成长股都将是理想的投资标的。同时我们也将会积极把握制度改革红利及经济结构转型所带来的投资机会,以获取更多的超额收益。

4.6 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	3,101,604,772.88	56.57
	其中:股票	3,101,604,772.88	56.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,557,351.80	0.21
	其中:债券	11,557,351.80	0.21
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,000,000,000.00	18.24
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,366,101,578.97	24.92
8	其他资产	3,298,651.51	0.06
9	合计	5,482,562,355.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	85,026,956.19	1.90
C	制造业	856,573,338.07	19.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	131,825,732.10	2.95
E	建筑业	208,416,030.36	4.67
F	批发和零售业	41,441,443.78	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	95,587,502.89	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,516,419.46	0.33
J	金融业	1,192,765,452.25	26.72
K	房地产业	348,966,216.42	7.82
L	租赁和商务服务业	67,848,618.96	1.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,276,693.13	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	31,360,369.27	0.70
S	综合	-	-
	合计	3,101,604,772.88	69.47

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	21,157,311	361,155,298.77	8.09
2	601318	中国平安	7,927,175	285,378,300.00	6.39
3	600048	保利地产	22,804,269	242,637,422.16	5.43
4	600036	招商银行	6,524,260	117,371,437.40	2.63
5	000333	美的集团	3,464,617	113,708,729.94	2.55
6	000002	万科A	4,351,186	106,299,473.98	2.38
7	002081	金螳螂	5,289,979	98,816,807.72	2.21
8	000625	长安汽车	5,735,814	97,336,763.58	2.18
9	600887	伊利股份	5,760,056	94,637,720.08	2.12
10	600741	华域汽车	5,554,667	93,651,685.62	2.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,557,351.80	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,557,351.80	0.26

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	60,000	8,260,200.00	0.19
2	132005	15国资EB	17,470	2,008,001.80	0.04
3	132002	15天集EB	11,210	1,289,150.00	0.03

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十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
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贵金属投资明细
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2
本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,882,678.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	242,375.64
5	应收申购款	1,173,597.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,298,651.51

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	8,260,200.00	0.19

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,350,837,088.35
报告期期间基金总申购份额	276,062,782.65
减:报告期期间基金总赎回份额	268,379,744.81
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,358,520,126.19

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	64,562,182.22
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	64,562,182.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.92

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、《南方成份精选混合型证券投资基金基金合同》。
2、《南方成份精选混合型证券投资基金托管协议》。
3、南方成份精选混合型证券投资基金2015年4季度报告原文。
8.2 存放地点
深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦31-33层
8.3 查阅方式
网站:http://www.nffund.com

南方创新经济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。

本报告中财务资料未经审计。

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	南方创新经济灵活配置混合
交易代码	001053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月24日
报告期末基金份额总额	1,849,688,479.60份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,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定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
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率低于股票基金,高于债券基金、货币市场基金。
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: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"南方创新经济"。

§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	283,269,460.47
2.本期利润	475,735,803.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.2278
4.期末基金资产净值	1,895,719,393.63
5.期末基金份额净值	1.025

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。

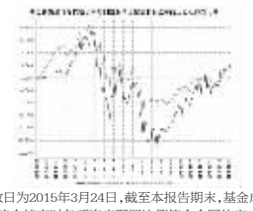
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	27.65%	1.91%	10.65%	1.01%	17.00%	0.90%

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:本基金的基金合同生效日为2015年3月24日,截至本报告期末,基金成立未满1年;本基金建仓期为本基金合同生效之日起6个月,建仓结束时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
		任职日期	离任日期		
杜冬松	本基金基金经理	2015年3月24日	-	13年	第三军医大学医学硕士,具有基金从业资格。曾担任天津272医院外科主治医师、深圳健安医药市场部部长、中新药业成药分公司学术推广部部长;2002年4月至2008年8月,历任平安证券研究所研究员、医药行业首席研究员、行业部副总经理。2008年9月加入南方基金,任研究部医药行业首席研究员和消费组组长;2012年3月至2015年4月,任南方消费基金经理;2013年7月至今,任南方高端装备(原金枫油)基金经理;2014年1月至今,任南方医保基金经理;2015年3月至今,任南方创新经济的基金经理。
窦晖	本基金基金经理	2015年6月19日	-	6年	北京大学西方经济学硕士,具有基金从业资格、金融分析师(CFA)资格,2009年7月加入南方基金,担任研究部研究员、高级研究员;2014年2月至2015年5月,任南方新优享基金经理助理;2015年5月至今,任南方新优享基金经理;2015年6月至今,任南方创新经济基金经理。

注:1.对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遵规守信情况的说明

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《南方创新经济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 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

四季度制造业景气仍在低位徘徊,汽车、地产相关刺激政策的效果也在减弱,通胀水平则在低位企稳。我们认为主要的风险来自于汇率。美国12月就业数据强劲,央行公布12月外汇储备创纪录地下降了1079亿美元,且1月以来外汇市场美元交易量飙升,均显示汇率贬值压力仍大。

四季度A股市场大幅反弹,其中小市值股票反弹更大。整个四季度,沪深300指数上涨16.49%,中证500指数上涨24.4%,创业板指数上涨30.32%。行业方面,代表新兴成长的计算机行业和兼具保险举牌概念和转型预期的房地产行业领涨,转型股较多的化工、通信等行业表现也很好,钢铁、银行、交运等行业涨幅相对落后。

四季度创新经济基金保持了中性偏高的仓位,也重仓了不少新兴产业和转型新兴产业的高弹性股票,较好的分享了市场反弹的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年四季度,本基金净值增长27.65%,同期业绩比较基准增长10.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度经济,我们认为随着汽车和地产相关刺激政策的出台,四季度经济有望短暂企稳,但中长期角度来看,改革与创新才是长期趋势。

我们认为四季度市场信心将有所恢复,仍然战略看好新经济。个股选择方面偏好估值合理的白马成长和短期超跌、代表转型方向的新兴产业龙头公司。

4.6 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	1,543,900,897.14	77.49
	其中:股票	1,543,900,897.14	77.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	443,229,701.78	22.25
8	其他资产	5,168,424.32	0.26
9	合计	1,992,299,023.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	24,101,128.80	1.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	959,076,030.14	50.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,921,889.00	1.05
F	批发和零售业	139,563,766.24	7.36
G	交通运输、仓储和邮政业	13,408,164.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,361,634.45	5.24
J	金融业	91,826,554.61	4.84
K	房地产业	41,340,418.00	2.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,042,648.88	1.69
N	水利、环境和公共设施管理业	78,682,100.82	4.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	44,576,562.20	2.35
S	综合	-	-
	合计	1,543,900,897.14	81.44

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300078	思创医惠	2,084,862	101,741,265.60	5.37
2	002137	麦达数字	3,293,732	75,755,836.00	4.00
3	300450	先导股份	512,291	50,916,602.49	2.69
4	603108	润达医疗	486,414	49,896,348.12	2.63
5	300187	永清环保	903,659	48,526,488.30	2.56
6	603456	九洲药业	662,253	47,092,810.83	2.48
7	000638	万方发展	1,369,000	41,822,950.00	2.21
8	300038	梅泰诺	721,604	40,900,514.72	2.16
9	002450	康得新	1,019,428	38,840,206.80	2.05
10	300109	新开源	345,201	35,918,164.05	1.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。
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
注:本基金本报告期末未持有债券。
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十名资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
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贵金属投资明细
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2
基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,435,048.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96,055.79
5	应收申购款	638,320.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,168,424.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300038	梅泰诺	40,900,514.72	2.16	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,191,600,200.45
报告期期间基金总申购份额	19,174,094.77
减:报告期期间基金总赎回份额	361,085,815.62
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,849,688,479.60

注:本基金的基金合同生效日为2015年3月24日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,222,222.22
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,222,222.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.61

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同
2、南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议
3、南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金2015年4季度报告原文
8.2 存放地点
深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦31-33层
8.3 查阅方式
网站:http://www.nffund.com

南方大数据100指数证券投资基金

【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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月01日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方大数据100指数
交易代码	001113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月24日
报告期末基金份额总额	7,871,887,467.49份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.5%,年跟踪误差不超过6%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	大数据100指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

§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	1,116,382,993.91
2.本期利润	1,989,356,986.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.2424
4.期末基金资产净值	7,620,787,946.05
5.期末基金份额净值	0.9681

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;

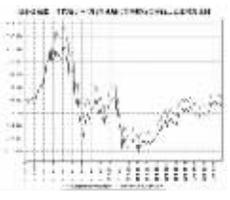
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	32.45%	2.21%	28.98%	2.20%	3.47%	0.01%

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



§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	6,562,972,985.05	78.81
	其中:股票	6,562,972,985.05	78.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	929,146,956.80	11.16
8	其他资产	835,662,859.82	10.03
9	合计	8,327,782,801.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值