

南方安心保本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
基金管理人的董事会及高级管理人员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。
基金销售机构承诺不以任何方式向投资者进行误导性陈述，确保复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金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。
本基金合同生效未超过6个月。
本基金报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称:南方安心保本混合型证券投资基金

交易代码:202213

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年12月1日

报告期末基金份额总额:3,983,638,662.99份

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下，有效控制风险，实现基金资产的长期增值。

投资策略:本基金通过“不投资于股票”的投资策略，以实现保本增值的目標。TPPF（Time Protection Portfolio Protection）即购买本息保值产品，该策略将投资组合收益的增加部分，TPPF策略实现了在保本投资的基础上，通过定期投资于货币市场基金，使投资组合的收益增加部分，能够与保本投资的收益增加部分相匹配，从而实现保本增值。

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为：“三月期银行存款利率+0.6%”。

风险收益特征:本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

基金管理人:南方基金管理有限公司

基金托管人:重庆三峡担保集团股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值显示其他信息披露项下，可简称为“南方安心”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2015年10月1日-2015年12月31日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 56,771.79元

2.本期利润 111,106,207.48元

3.期初至报告期利润 1,028.23元

4.期末基金资产净值 3,983,744,681.99元

5.期末基金份额净值 1.000元

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,本期利润为期初至报告期利润加上本期已实现收益。

2.所列数据未包含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据。

3.21 本基金报告期的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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去三个月 0.62% 0.71% 0.01% 0.16% 0.61%

注:根据本基金的合同约定,本基金将保本周期内每期的净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差,以及与南方安心保本混合型证券投资基金保本周期内每期操作策略相比较,转入下一保本周期的有关数据,并以此类推,本基金的第一个保本周期为自2012年12月1日至2015年12月21日止;第二个保本周期为2015年12月22日至2018年12月21日止。

3.22 本基金合同生效以来基金的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:本基金合同生效以来基金的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(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 离任日期

陈健 本基金基金经理、投资总监 2012年12月21日 15年

研习力学,具有基金从业资格,2000年加入南方基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理,2004年12月至今,任南方基金管理有限公司,2006年3月-2006年6月,任南方基金管理有限公司,2006年6月-2007年1月,任南方基金管理有限公司,2007年1月-2014年1月,任南方基金管理有限公司,2012年1月至今,任南方基金管理有限公司,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司。

刘文波 本基金基金经理 2015年12月30日 3年

北京大学金融学硕士,具有基金从业资格,2012年加入南方基金管理有限公司,具有2年半定期存款研究经验,基金经理助理,历任行业研究员、基金经理助理,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司。

卢玉媚 本基金基金经理 2015年12月30日 7年

清华大学计算机系硕士,具有基金从业资格,2008年加入南方基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司,2015年3月至今,任南方基金管理有限公司。

孟飞 本基金基金经理 2014年1月19日 2015年12月30日 7年

金融学硕士,具有基金从业资格,曾任任第一财经证券公司交易员、交易助理,高盛(中国)有限公司交易员,2010年1月加入南方基金管理有限公司,2010年1月至今,任南方基金管理有限公司,2010年1月至今,任南方基金管理有限公司,2010年1月至今,任南方基金管理有限公司。

注:1. 对基金的基金经理,其“任职日期”为根据公司决定的解聘日期,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期,对此前的非任职基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业人员不得买卖本公司的证券,证券从业人员不得买卖本公司的证券。

3.42 除管理人之外的专营部门

本基金在本报告期内不存在专营交易行为。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且成交金额较大的情形,且在交易所公开竞价中不存在成交金额较大的情形。

4.41 报告期内本基金的资产配置和投资策略说明

4.42 报告期内本基金的资产配置和投资策略说明

4.43 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.44 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.45 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.46 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.47 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.48 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.49 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.50 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.51 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.52 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.53 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.54 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.55 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.56 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.57 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.58 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.59 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.60 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.61 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.62 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.63 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.64 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.65 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.66 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.67 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.68 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.69 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.70 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.71 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.72 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.73 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.74 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.75 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.76 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.77 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.78 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.79 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.80 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.81 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.82 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.83 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.84 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.85 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.86 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.87 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.88 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.89 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.90 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.91 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.92 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.93 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.94 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.95 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.96 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.97 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.98 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.99 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.10 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.11 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.12 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.13 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.14 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.15 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.16 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.17 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.18 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.19 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.20 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.21 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.22 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.23 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.24 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.25 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.26 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.27 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.28 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.29 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.30 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.31 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.32 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.33 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.34 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.35 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.36 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.37 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.38 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.39 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.40 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.41 报告期内本基金的资产配置和操作分析

4.42 报告期内本基金的资产配置和操作分析