南方安心保本混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方安心保本混合
基金主代码	202213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月21日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,983,638,962.28份
基金合同存续期	不定期

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“南方安心”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略,在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金按照时间不变性投资组合保险(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection)策略进行资产配置,以实现保本和增值的目标。TIPP策略设置了一条保本投资底线,该底线随着投资组合收益的增加而调整。TIPP策略改进了CPPI中保本投资底线的调整方式,每当收益率达到一定的比率并持续一段时间后,保本投资底线相应提高一定比例,以锁定一部分前期投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:三年期定期存款税后收益率+0.5%。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95555
传真		0755-82763889	0755-83195201

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	437,199,465.88	165,646,753.69	68,733,819.52
本期利润	340,402,100.76	335,531,001.41	-4,542,655.21
加权平均基金份额本期利润	0.3532	0.2114	-0.0020
本期基金份额净值增长率	26.55%	22.77%	-0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0464	0.1485	-0.0028
期末基金资产净值	3,983,744,681.99	1,513,212,249.20	1,946,634,213.66
期末基金份额净值	1.000	1.224	0.997

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.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.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。

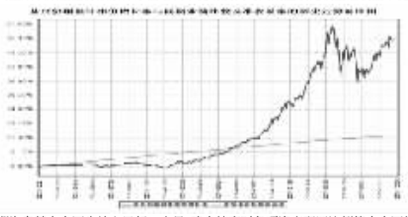
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	9.87%	0.62%	0.71%	0.01%	9.16%	0.61%
过去六个月	3.20%	1.06%	1.54%	0.01%	1.66%	1.05%
过去一年	26.47%	0.98%	3.49%	0.01%	22.98%	0.97%
过去三年	54.65%	0.60%	13.28%	0.01%	41.37%	0.59%
自基金合同生效起至今	54.80%	0.60%	13.44%	0.01%	41.36%	0.59%

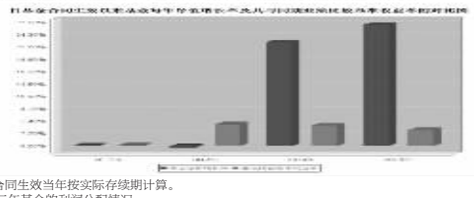
注:根据《南方安心保本混合型证券投资基金基金合同》以及《南方安心保本混合型证券投资基金保本期到期操作规则及转入下一保本期的相关规则的提示性公告》的相关规定,本基金的第一个保本期为三年,自2012年12月21日至2015年12月21日止;第二个保本期为三年,自2015年12月29日至2018年12月29日止。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:本基金建仓期为自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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:基金合同生效当年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	5.0000	380,980,962.94	-	380,980,962.94	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	5.0000	380,980,962.94	-	380,980,962.94	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳,注册资本3亿元人民币。股东结构为:华泰证券股份有限公司(45%);深圳市投资控股有限公司(30%);厦门国际信托有限公司(15%);兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模超过5,000亿元,旗下管理85只开放式基金,多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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	2012年12月21日	2016年1月26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;2006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。
刘文良	本基金基金经理	2015年12月30日	-	3年	北京大学金融学专业硕士,具有基金从业资格。2012年7月加入南方基金,具有2年半固定收益研究经验,半年基金经理助理经验,历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师、南方永利基金经理助理;2015年8月至今,任南方永利基金经理;2015年12月至今,任南方弘利、南方安心基金经理。
卢玉珊	本基金基金经理	2015年12月30日	-	7年	清华大学会计学硕士,具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金,历任研究部研究员、高级研究员,负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作;2015年2月至2015年12月,任南方成份、南方安心的基金经理助理;2015年5月至2015年12月,任南方改革机遇的基金经理助理;2015年12月至今,任南方安心基金经理。
孟飞	本基金基金经理	2014年9月19日	2015年12月30日	8年	金融学硕士学历,具有基金从业资格。曾担任第一创业证券公司债券交易员、交易经理、高级交易经理。2013年5月加入南方基金,任固定收益部高级研究员,2014年7月至2015年12月,任南方启元基金经理;2014年7月至2015年12月,任南方50债基金经理;2014年7月至2015年12月,任南方中票基金经理;2014年9月至2015年12月,任南方安心基金经理;2015年1月至2015年12月,任南方润元基金经理。
骆帅	本基金基金经理助理	2014年3月31日	2015年5月28日	6年	清华大学管理科学与工程专业硕士,具有基金从业资格,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3月至2015年5月,任南方成份、南方安心基金经理助理;2015年5月至今,任南方高端装备基金经理;2015年6月至今,任南方价值、南方成长基金经理。
卢玉珊	本基金基金经理助理	2015年2月26日	2015年12月30日	7年	清华大学会计学硕士,具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金,历任研究部研究员、高级研究员,负责纺织服装、商贸零售的行业研究工作;2015年2月至2015年12月,任南方成份、南方安心的基金经理助理;2015年5月至2015年12月,任南方改革机遇的基金经理助理;2015年12月至今,任南方安心基金经理。

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。

3.基金管理人于2016年1月27日发布变更基金经理的公告,陈键于2016年1月26日起不再担任本基金的基金经理。

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《南方安心保本混合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,没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资管理制度和细则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占优比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 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%的交易次数为9次,其中5次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致,2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,2次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年全年,得益于前期累积的安全垫,安心基金在资产配置策略上积极配置权益类资产,力求最大程度发挥资金投资效率。在行业配置和个股选择策略上,沿着安全低估值蓝筹和估值合理的中高成长股两条主线展开,我们一方面对优势制造业如汽车、汽车零部件等行业中质地优良,同时兼具国企改革预期的低估值蓝筹股保持了适当配置,另一方面积极挖掘互联网+、综合金融改革、传媒通信、医疗保健、安防智能及稳定类消费等主题的投资机会,继续对大量投资标的进行了广泛调研,积极布局,取得了较好的效果。同时回避估值严重泡沫化、高度脱离基本面支撑的股票,也正是因此在三季度的股灾中,回撤基本可控,同时基于对选股的信心,四季度保持了较高的股票仓位,有效分享了市场的反弹。

安全资产方面,经济下行压力大,货币政策放松,收益率曲线上半年陡峭化下行,下半年平坦化下行,信用利差压缩,南方安心上半年维持较高的信用债仓位,严格控制信用风险的情况下精选个券,获取持有收益,基金合同规定保本期到期资产全部变现,下半年信用债陆续卖出止盈,同时对流动性好的利率债适当增加波段操作,获取利率下行过程中的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年全年,沪深300指数上涨约5.58%,中证500上涨34.12%,创业板指数上涨约84.41%,南方安心保本基金期间净值上涨约26.47%,权益类资产业绩表现超越市场主要指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

15年12月21日,安心保本结束了第一期的运作,于12月29日开启了第二期的操作。

2016年的宏观环境会更为复杂,短期看物价数据仍然偏弱,叠加海外股市和利率回落,美联储加息大概率推后,缓解了人民币贬值压力,信贷增速也出现了一段蜜月期。但较高货币增速,必然对未来的通胀和人民币汇率带来压力,因此后续将面临宽松力度减弱的风险。同时需要密切观察通胀抬头的可能性,以及由此带来的货币政策实质转向。

人民币汇率问题可能会贯穿全年,从中期看,对资本外流的担忧会始终还是会限制货币宽松力度。乐观估计,1季度的货币政策会对2季度经济有一定托底作用;大宗商品低位企稳,PPI也有所反映,可能会有一个小的补库存周期。总体来看,地产库存、过剩产能都很难短期消化。利润方面,从供给侧改革的角度,也是一个长期的过程,很难看到今年就出现煤炭、钢铁部门利润好转。

随着信息传播速度和新事物出现频率的加快也都使得市场短期的趋同性加强,进而导致波动加剧。市场在15年下半年至今的三次股灾,较大程度地释放了估值风险,与此同时,市场参与者的信心、情绪和未来预期均遭受了较大考验,从历史经验看,市场的调整修复需要时间完成,企业盈利的基本面也需要时间恢复,单纯靠估值提升获得盈利的上行空间不大,未来一段时间内的股票市场维持震荡筑底的概率偏大,在此过程中严格控制交易成本,坚持选股标准的重要性将有所上升,我们将继续坚持理性投资、价值投资和顺势而为的投资理念。

风险偏好较低的资金占比持续提高会带来市场风格的转变,我们一方面将继续围绕结构改革和高分红率等方面挖掘投资机会,另一方面,我们也将积极关注部分成长股随着股价超跌可能带来的投资机会。人工智能、VR、教育、养老医疗、民参军等也是我们会持续关注的方向。

安全资产方面,2015年底的中央经济工作会议确定供给侧改革和需求侧托底的基调,2016年经济仍有下行压力,通胀维持较低水平,货币政策维持宽松格局,虽然不会大幅放水,但资金利率稳定性明显上升,上述因素有利于债券市场,同时我们也注意到目前债券绝对收益率已经降至历史较低水平,货币政策边际上进一步宽松的阻力上升,未来利率下行的斜率将明显减小,波动加大,需要关注稳增长刺激政策、大宗商品价格、美联储加息、汇率波动等潜在风险因素,在新的保本期初期,坚持稳健操作原则,逐渐积累安全垫,以中短期限、中高评级信用债为主,严格控制信用风险,耐心等待提高组合久期的机会,少量参与长端利率债的阶段性行情。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规,坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。

本报告期内,本基金管理人开展了基金管理公司合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作,制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度,进一步完善了公司的内控体系;对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核,检查业务开展的合规性和制度执行的有效性;采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,加强对日常投资运作的管理和监控,督促投研交易业务的合规开展;针对新出台的法律法规和监管要求,积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试,不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养;全面参与新产品设计、新业务拓展工作;严格审查基金宣传推介材料,及时检查基金销售业务的合法合规情况;完成各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性;监督客户投诉处理,重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,积极健全内部管理制度,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总经理、研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;保本周期内,本基金仅采取现金分红一种收益分配方式,不进行红利再投资。转型为“南方核心竞争混合型证券投资基金”后,基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本基金于2015年12月16日进行收益分配(每10份基金份额派发红利5.00元)。

4.10报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本基金2015年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2016)第21271号“标准无保留意见的审计报告”,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:南方安心保本混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	231,739,230.40	60,576,745.40
结算备付金	923,681.88	39,597,631.83
存出保证金	386,840.03	232,428.05
交易性金融资产	43,163,992.80	2,103,647,921.70
其中:股票投资	36,072,992.80	592,411,503.00
基金投资	-	-
债券投资	7,091,000.00	1,511,236,418.70
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,663,900,000.00	-
应收证券清算款	1,065,583,509.50	-
应收利息	311,198.27	33,670,662.08
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,006,008,452.88	2,237,725,389.06
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	666,999,372.50
应付证券清算款	19,902,394.22	35,463,356.86
应付赎回款	-	17,399,899.32
应付管理人报酬	1,162,525.37	1,775,439.01
应付托管费	172,225.98	263,028.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	835,625.32	2,113,801.28
应交税费	-	-
应付利息	-	110,364.81
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	191,000.00	387,878.07
负债合计	22,263,770.89	724,513,139.86
所有者权益:		
实收基金	3,798,925,879.54	1,236,499,793.13
未分配利润	184,818,802.45	276,712,456.07
所有者权益合计	3,983,744,681.99	1,513,212,249.20
负债和所有者权益总计	4,006,008,452.88	2,237,725,389.06

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额3,983,638,962.28份。

7.2 利润表

会计主体:南方安心保本混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一.收入	377,369,075.82	384,802,647.66
1.利息收入	58,438,134.31	92,970,726.27
其中:存款利息收入	984,163.08	990,648.93
债券利息收入	55,370,483.19	91,969,714.00
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,083,488.04	10,363.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	412,347,463.10	116,523,821.31
其中:股票投资收益	346,878,046.41	124,858,258.10
基金投资收益	-	-
债券投资收益	59,134,090.70	-19,259,848.02
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,335,325.99	10,925,411.23
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-96,797,365.12	169,884,247.72
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	3,380,843.53	5,423,852.36
减:二、费用	36,966,975.06	49,271,646.25
1. 管理人报酬	17,992,792.68	22,897,470.60
2. 托管费	2,665,598.91	3,392,217.91
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,519,767.79	3,836,756.52
5. 利息支出	9,308,001.29	18,661,620.62
其中:卖出回购金融资产支出	9,308,001.29	18,661,620.62
6. 其他费用	480,814.39	483,580.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	340,402,100.76	335,531,001.41
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	340,402,100.76	335,531,001.41

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方安心保本混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	1,236,499,793.13	276,712,456.07	1,513,212,249.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	340,402,100.76	340,402,100.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2,562,426,086.41	-51,314,791.44	2,511,111,294.97
其中:1.基金申购款	3,413,908,175.16	165,992,578.75	3,579,900,753.91
2.基金赎回款	-851,482,088.75	-217,307,370.19	-1,068,789,458.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-380,980,962.94	-380,980,962.94
五.期末所有者权益(基金净值)	3,798,925,879.54	184,818,802.45	3,983,744,681.99

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	1,952,155,993.74	-5,521,780.08	1,946,634,213.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	335,531,001.41	335,531,001.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-715,656,200.61	-53,296,765.26	-768,952,965.87
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-715,656,200.61	-53,296,765.26	-768,952,965.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	1,236,499,793.13	276,712,456.07	1,513,212,249.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

杨小松 徐超 徐超

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

项目	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东的子公司
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	247,503,968.29	6.13%	525,407,516.39	20.66%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	407,000,381.75	80.25%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	218,599.24	6.00%	-417.74	-0.05%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
华泰证券	464,688.68	20.33%	464,688.68	22.20%

注:

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方投资

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,992,792.68	22,897,470.60
其中:支付销售机构的客户维护费	5,731,109.32	7,408,561.01

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.35%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,665,598.91	3,392,217.91

注:支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

项目		本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
		期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	231,739,230.40	586,173.91	60,576,745.40