

南方利达灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

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。

基金托管人北京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。

本报告期自基金成立日 2015 年 07 月 08 日起至 2015 年 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 | 南方利达灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 001566 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 7 月 8 日 | |
| 基金管理人 | 南方基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 2,861,318,240.41 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 南方利达 A | 南方利达 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 001566 | 001567 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,571,639,669.01 份 | 1,289,678,571.40 份 |

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“南方利达”。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 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及投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，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 | 本基金的业绩比较基准为：人民币三年期定期存款利率（税后）+2% |
| 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。 |

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 | 北京银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 鲍文革 | 刘晔 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 010-66223586 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com | liuyel@bankofbeijing.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 95526 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 010-66225309 |

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 | http://www.nffund.com |
|--------------------|---|

| | |
|------------|------------------|
| 址 | |
| 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 7 月 8 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|------------------|
| | 南方利达 A | 南方利达 C |
| 本期已实现收益 | 14,419,764.71 | 4,322,732.37 |
| 本期利润 | 20,912,741.05 | 6,681,636.23 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0035 | 0.0052 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.30% | 0.50% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末 | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0089 | 0.0088 |
| 期末基金资产净值 | 1,592,545,225.68 | 1,306,677,636.23 |
| 期末基金份额净值 | 1.013 | 1.013 |

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。

4. 本基金合同生效日为 2015 年 07 月 08 日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

5. 本报告期内,基金持有人实际持有本基金 C 类份额的期间为 2015 年 11 月 12 日—2015 年 12 月 31 日。

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

南方利达 A

| 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 | 1.10% | 0.04% | 1.20% | 0.02% | -0.10% | 0.02% |

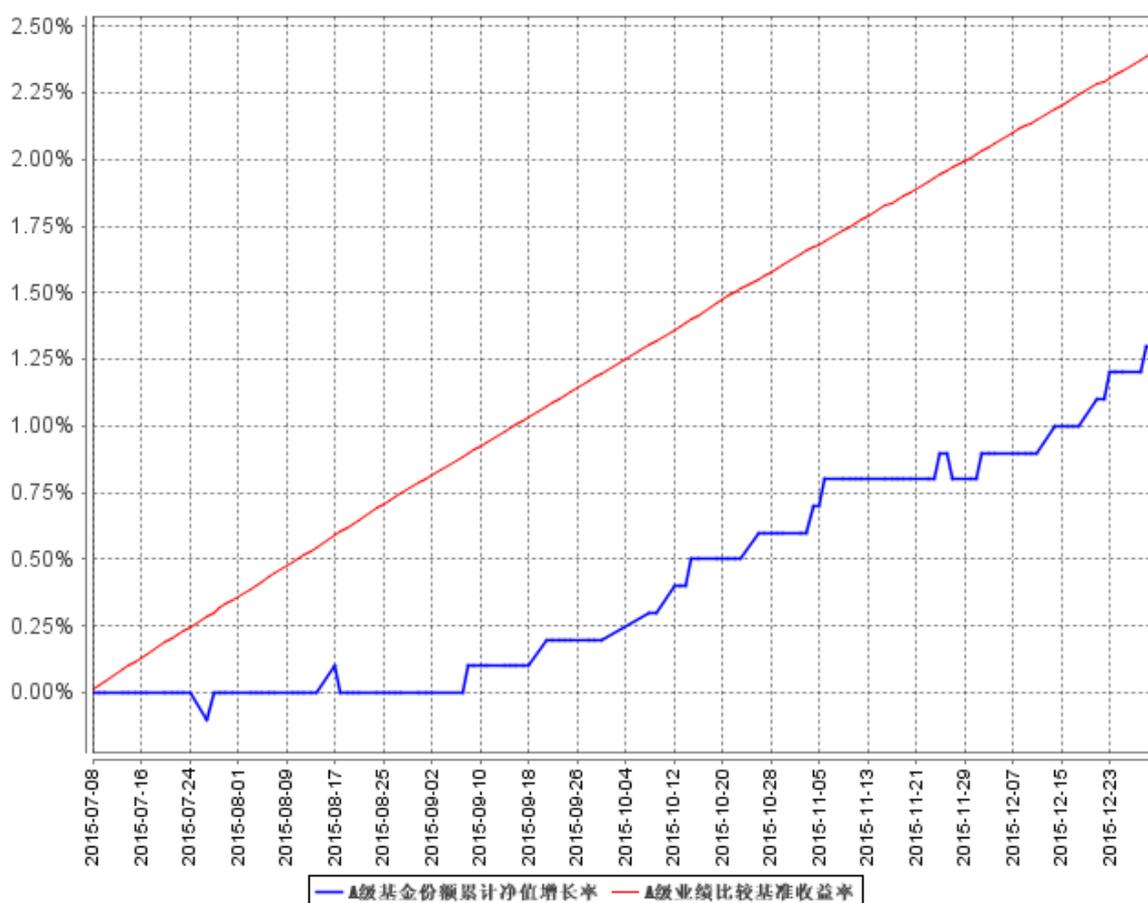
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | 1.30% | 0.04% | 2.41% | 0.01% | -1.11% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.30% | 0.04% | 2.41% | 0.01% | -1.11% | 0.03% |

南方利达 C

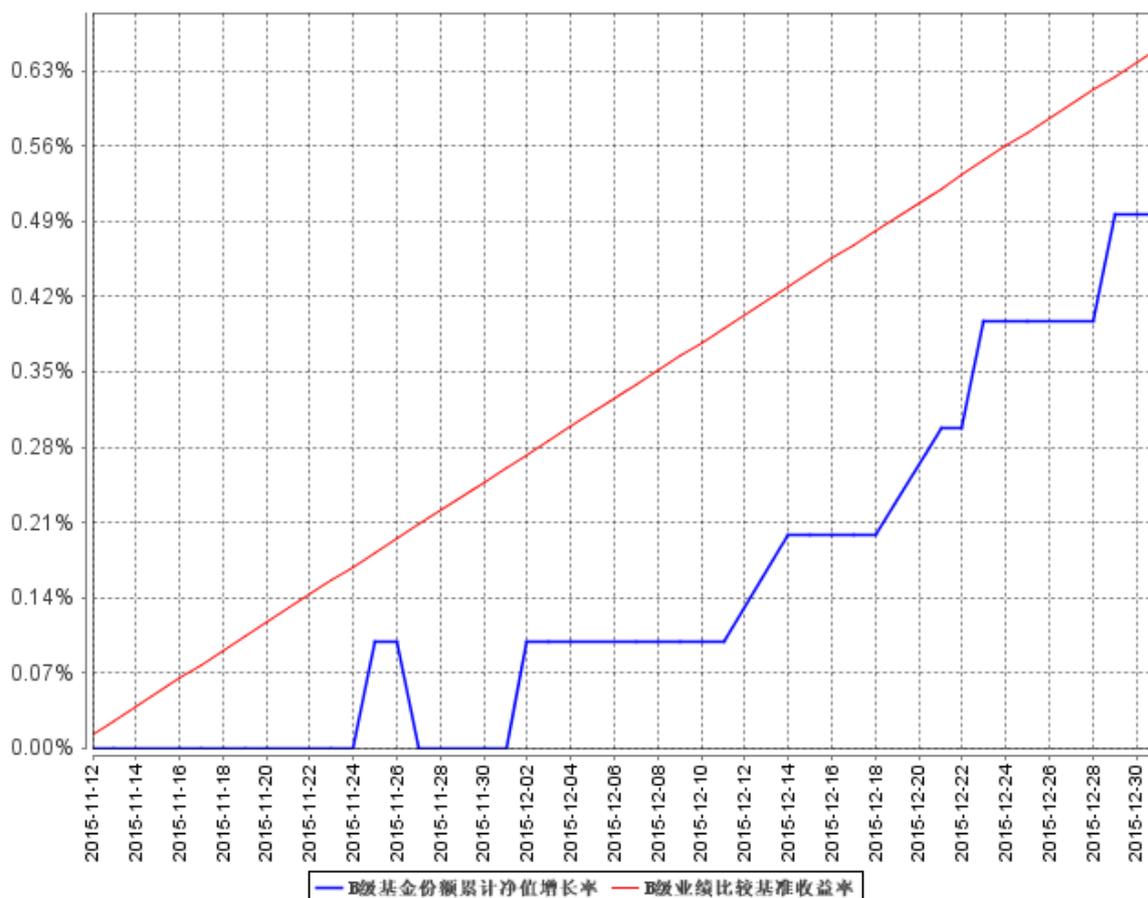
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.50% | 0.04% | 0.65% | 0.01% | -0.15% | 0.03% |
| 过去六个月 | 0.50% | 0.04% | 0.65% | 0.01% | -0.15% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.50% | 0.04% | 0.65% | 0.01% | -0.15% | 0.03% |

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



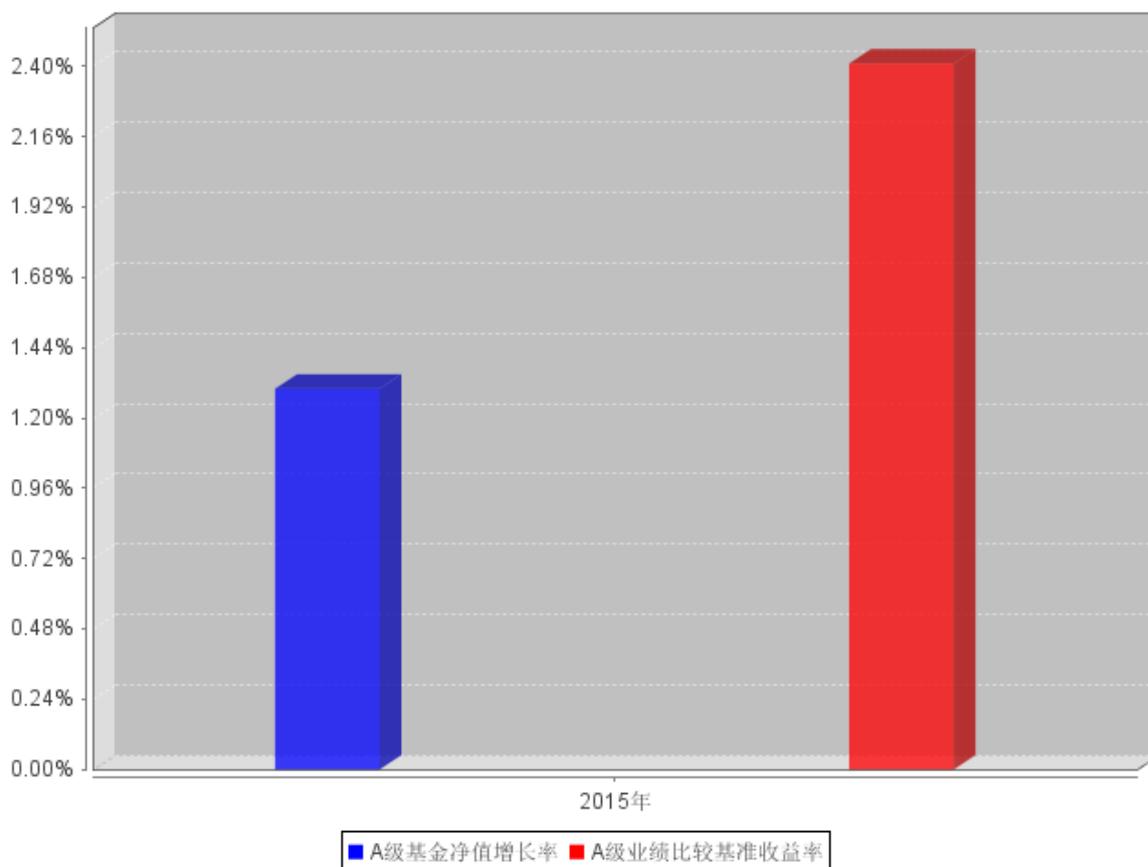
B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



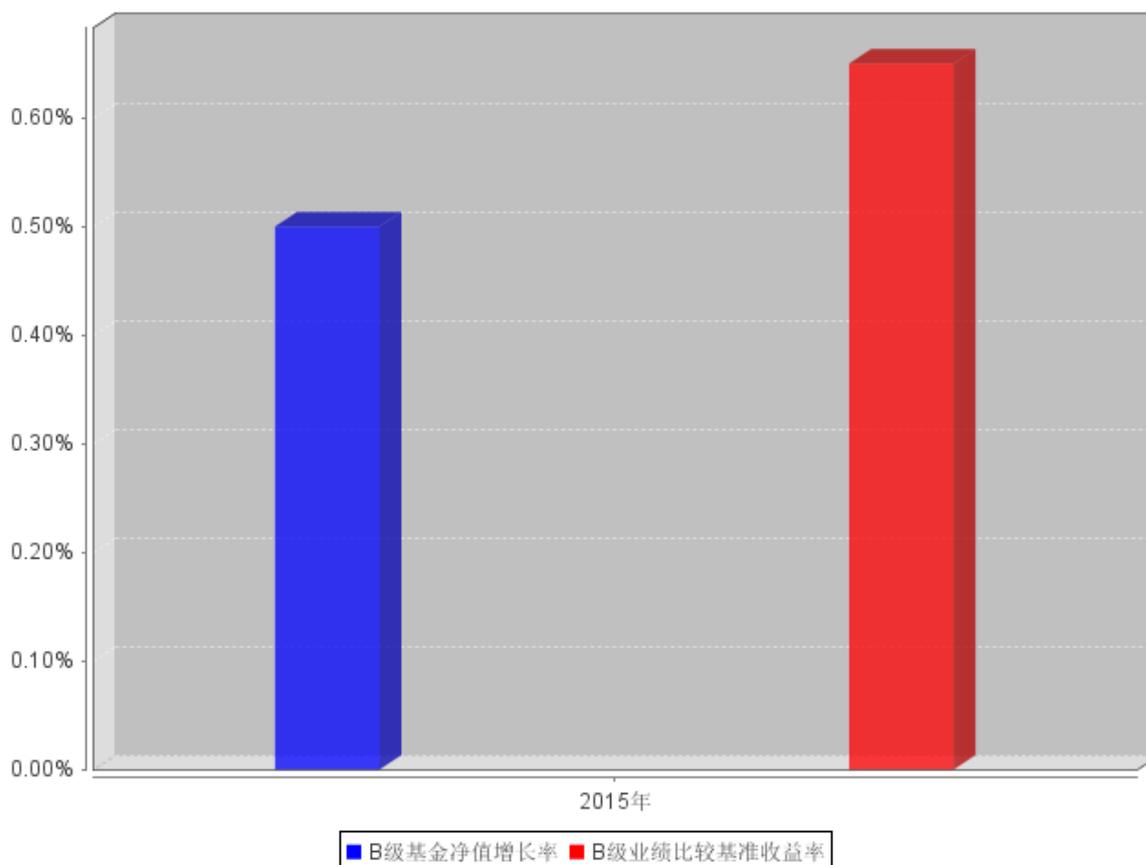
注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截止本报告期末建仓期未结束。

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

A级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对比图



B级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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：过往三年本基金未有利润分配事项。

§ 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 | | |
| 吴剑毅 | 本 基 金 经 理 | 2015 年 7 月 8 日 | - | 7 年 | 清华大学金融学硕士，具有基金从业资格。2009 年 7 月加入南方基金，任南方基金研究部金融行业研究员；2012 年 3 月至 2014 年 7 月，担任南方避险、南方保本基金经理助理；2014 年 7 月至今，任南方恒元基金经理；2015 年 5 月至今，任南方利众基金经理；2015 年 7 月至今，任南方利达基金经理；2015 年 9 月至今，任南方消费活力基金经理；2015 年 10 月至今，任南方顺达基金经理；2015 年 11 月至今，任南方利安、南方顺康基金经理。 |
| 姚万宁 | 本 基 金 经 理 助 理 | 2015 年 11 月 23 日 | - | 3 年 | 深圳大学金融学硕士，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入南方基金，担任投资部投资账户助理；2015 年 11 月至今，任南方恒元、南方利众、南方利达、南方利安、南方顺达、南方顺康的基金经理助理。 |

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，除首任基金经理外，“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合规守信情况的说明

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《南方利达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，两两组合同单日、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，国内经济依然存在下行压力。截至报告期末，制造业PMI已连续5个月低于荣枯线，虽然政策持续发力，央行连续降息、降准为经济保驾护航，定向调控力度也不断加强，但投资拉动经济增长的边际效应却逐渐降低，新订单与新出口订单指数仍然在低位震荡，显示内外需低迷。市场方面，在杠杆资金的疯狂推升下，上证指数在上半年巨幅上涨，于6月12日创出新高后急转直下，经过3季度的大幅调整后在4季度迎来了难得的反弹，全年上证综指和创业板指分别上涨9.4%和84.4%。

受 IPO 暂停的影响,本基金自 2015 年 7 月成立至 2015 年 10 月未能参与新股申购,基金运作采用类保本基金操作思路进行。主要的运作策略是 CPPI 策略,即主要资产配置在债券等固定收益资产上积累安全垫,在现有的安全垫基础上适度配置股票等风险资产,随着安全垫的逐渐累积,再逐步提升股票部分的仓位,以获取超额收益。随着 2015 年 11 月新股的再度重启,我们积极参与新股的网下申购,同时也积极参与可交换债和可转债的申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金 A 类份额净值为 1.013 元,本报告期份额净值增长率为 1.3%,同期业绩比较基准增长率为 2.41%; C 类份额净值为 1.013 元,本报告期份额净值增长率为 0.5%,同期业绩比较基准增长率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新年伊始,汇率及减持问题触发了 A 股惨烈的下跌,万得全 A 指数累计跌幅高达 20%。剧烈地下跌导致大量的止损盘集中爆发,出现惨烈的多杀多,短期市场超跌。但是我们也应该看到,流动性宽松和无风险利率走低的背景并未发生变化,低风险资金持续流入股市的步伐也没有改变。经历了短期剧烈的调整后,不少估值洼地逐步显现。在大盘跌到 2600 点附近时,不少上市公司反而加大了增持和回购的力度,产业资本也不时举牌上市公司,这股力量将成为 A 股中长期底部的有力支撑。

展望 2016 年,国内经济增速有望好于预期,受人民币贬值压力影响,货币政策空间不大,更多依赖财政刺激。股票方面,我们将重点配置估值安全、分红收益率高、有品牌价值的蓝筹股,它们将成为未来增量资金的重点关注对象。同时,择优买入股价跌破重要股东增持成本或者定增价格的公司。债市方面,考虑到 10 年期国债收益率水平已处于 10 年来的低点,同时信用利差也处于低位,我们对于债市保持谨慎,重点配置高评级、短久期的信用债,以获取持有到期收益为主。2016 年将是一级市场红利大释放的一年,转债特别是新股的发行速度都会加快。我们仍将坚守 CPPI 保本策略,积极把握一级市场红利,实现净值的平稳增长。

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；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，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；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别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，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 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

在本报告期内，本基金托管人在托管南方利达基金过程中，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和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、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

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2016)第 21297 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 | |
|--------------|--|----|
| 审计报告收件人 | 南方利达灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人 | |
| 引言段 | 我们审计了后附的南方利达灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“南方利达灵活配置基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 | |
| 管理层对财务报表的责任段 | <p>编制和公允列报财务报表是南方利达灵活配置基金 的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> | |
| 注册会计师的责任段 | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> | |
| 审计意见段 | 我们认为,上述南方利达灵活配置基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方利达灵活配置基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。 | |
| 注册会计师的姓名 | 薛竞 | 陈熹 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海市 | |

| | |
|--------|-----------------|
| 审计报告日期 | 2016 年 3 月 25 日 |
|--------|-----------------|

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方利达灵活配置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 | 附注号 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | | 59,605,889.88 |
| 结算备付金 | | 8,642,303.75 |
| 存出保证金 | | 455,293.84 |
| 交易性金融资产 | | 1,169,310,148.06 |
| 其中：股票投资 | | 54,436,264.56 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 1,114,873,883.50 |
| 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 | | 1,506,090,679.13 |
| 应收证券清算款 | | 318,708,696.67 |
| 应收利息 | | 9,131,386.42 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | | - |
| 资产总计 | | 3,071,944,397.75 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015 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 | | 170,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | 996.03 |
| 应付管理人报酬 | | 1,963,995.98 |
| 应付托管费 | | 490,999.00 |
| 应付销售服务费 | | 110,646.67 |

| | | |
|---------------|--|------------------|
| 应付交易费用 | | 32,895.66 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | | 122,002.50 |
| 负债合计 | | 172,721,535.84 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | | 2,861,318,240.41 |
| 未分配利润 | | 37,904,621.50 |
| 所有者权益合计 | | 2,899,222,861.91 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,071,944,397.75 |

注：

1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,861,318,240.41 份，其中 A 类基金份额总额为 1,571,639,669.01 份，基金份额净值为 1.013 元；C 类基金份额总额为 1,289,678,571.40 份，基金份额净值为 1.013 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：南方利达灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|------------------|-----|--|
| 一、收入 | | 42,872,701.23 |
| 1.利息收入 | | 42,842,488.73 |
| 其中：存款利息收入 | | 28,289,364.33 |
| 债券利息收入 | | 9,741,605.79 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 4,811,518.61 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -9,808,731.16 |
| 其中：股票投资收益 | | -10,102,581.27 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | | 265,645.55 |
| 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 | | 28,204.56 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 8,851,880.20 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 987,063.46 |
| 减：二、费用 | | 15,278,323.95 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.8.2.1 | 8,207,149.16 |
| 2. 托管费 | 7.4.8.2.2 | 5,605,787.28 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.8.2.3 | 174,764.35 |
| 4. 交易费用 | | 398,572.65 |
| 5. 利息支出 | | 677,150.00 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 677,150.00 |
| 6. 其他费用 | | 214,900.51 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 27,594,377.28 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 27,594,377.28 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方利达灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年7月8日(基金合同生效日)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） | 1,685,721,406.28 | - | 1,685,721,406.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 27,594,377.28 | 27,594,377.28 |
| 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） | 1,175,596,834.13 | 10,310,244.22 | 1,185,907,078.35 |
| 其中：1. 基金申购款 | 41,289,727,196.29 | 10,317,761.96 | 41,300,044,958.25 |
| 2. 基金赎回款 | -40,114,130,362.16 | -7,517.74 | -40,114,137,879.90 |
| 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） | 2,861,318,240.41 | 37,904,621.50 | 2,899,222,861.91 |

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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

南方利达灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1285号《关于准予南方利达灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》，由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方利达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,685,664,803.77元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第895号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方利达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年7月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,685,721,406.28份基金份额，其中认购资金利息折合56,602.51份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《南方利达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，并分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方利达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、

政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的 5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:人民币三年期定期存款利率(税后)+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方利达灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每份基金享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的

交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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),按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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

| 关联方名称 | 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 |
| 北京银行股份有限公司(“北京银行”) | 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 |
| 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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------------|---|
| | 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,207,149.16 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 38,069.46 |

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 0.80%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 X 0.80% / 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 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,605,787.28 |

注：支付基金托管人北京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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---|------------|------------|
| | 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 南方利达 A | 南方利达 C | 合计 |
| 南方基金 | - | 174,764.35 | 174,764.35 |
| 合计 | - | 174,764.35 | 174,764.35 |

注：注：支付 C 类基金份额销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

根据《南方基金关于旗下南方利达混合型基金 C 类基金份额销售服务费优惠的公告》和《南方基金关于继续开展旗下部分基金销售服务费优惠的公告》，自 2015 年 11 月 13 日起，销售服务费率调整为 0.10%，调整后，本基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.10% / 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：本基金本报告期内无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：本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

无。

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

| 关联方名称 | 本期 2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | |
|-------|--------------------------------------|---------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 北京银行 | 9,605,889.88 | 13,166,900.77 |

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 7.4.10.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-------------|-----------|--------|------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002778 | 高科石化 | 2015年12月28日 | 2016年1月6日 | 新股流通受限 | 8.50 | 8.50 | 5,600 | 47,600.00 | 47,600.00 | - |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 170,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 59,195,861.36 元，属于第二层次的余额为 1,110,114,286.70 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。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)，本基金于 2015 年 3 月 16 日起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(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 54,436,264.56 | 1.77 |
| | 其中：股票 | 54,436,264.56 | 1.77 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,114,873,883.50 | 36.29 |
| | 其中：债券 | 1,114,873,883.50 | 36.29 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 1,506,090,679.13 | 49.03 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 68,248,193.63 | 2.22 |
| 7 | 其他各项资产 | 328,295,376.93 | 10.69 |
| 8 | 合计 | 3,071,944,397.75 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 7,344,958.40 | 0.25 |
| C | 制造业 | 27,893,502.24 | 0.96 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 888,831.00 | 0.03 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|------|
| E | 建筑业 | 3,276,520.95 | 0.11 |
| F | 批发和零售业 | 1,122,293.44 | 0.04 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,427,400.00 | 0.05 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,425,307.12 | 0.08 |
| J | 金融业 | 6,193,594.80 | 0.21 |
| K | 房地产业 | 1,437,660.00 | 0.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 109,392.21 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,334,080.00 | 0.05 |
| 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 | 982,724.40 | 0.03 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 54,436,264.56 | 1.88 |

8.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000895 | 双汇发展 | 239,000 | 4,877,990.00 | 0.17 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 383,220 | 4,594,807.80 | 0.16 |
| 3 | 600031 | 三一重工 | 639,400 | 4,207,252.00 | 0.15 |
| 4 | 000825 | 太钢不锈 | 760,900 | 3,119,690.00 | 0.11 |
| 5 | 600028 | 中国石化 | 615,000 | 3,050,400.00 | 0.11 |
| 6 | 601808 | 中海油服 | 185,070 | 2,872,286.40 | 0.10 |
| 7 | 600005 | 武钢股份 | 823,800 | 2,858,586.00 | 0.10 |
| 8 | 002375 | 亚厦股份 | 159,300 | 2,512,161.00 | 0.09 |
| 9 | 600307 | 酒钢宏兴 | 625,400 | 2,395,282.00 | 0.08 |
| 10 | 600198 | 大唐电信 | 71,900 | 1,773,773.00 | 0.06 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|---------------|-----------------|
| 1 | 000895 | 双汇发展 | 57,379,085.59 | 1.98 |
| 2 | 600600 | 青岛啤酒 | 57,002,015.57 | 1.97 |
| 3 | 600068 | 葛洲坝 | 51,738,946.35 | 1.78 |
| 4 | 600409 | 三友化工 | 50,362,255.04 | 1.74 |
| 5 | 000018 | 中冠 A | 11,727,999.25 | 0.40 |
| 6 | 000001 | 平安银行 | 7,885,212.00 | 0.27 |
| 7 | 600031 | 三一重工 | 4,326,074.44 | 0.15 |
| 8 | 600028 | 中国石化 | 3,145,692.00 | 0.11 |
| 9 | 000825 | 太钢不锈 | 3,101,001.00 | 0.11 |
| 10 | 601808 | 中海油服 | 3,064,813.00 | 0.11 |
| 11 | 600005 | 武钢股份 | 2,899,776.00 | 0.10 |
| 12 | 600307 | 酒钢宏兴 | 2,517,452.34 | 0.09 |
| 13 | 000750 | 国海证券 | 2,517,188.90 | 0.09 |
| 14 | 002375 | 亚厦股份 | 2,368,977.16 | 0.08 |
| 15 | 000068 | *ST 华赛 | 2,336,865.00 | 0.08 |
| 16 | 000933 | 神火股份 | 2,001,370.00 | 0.07 |
| 17 | 600395 | 盘江股份 | 1,990,286.00 | 0.07 |
| 18 | 600372 | 中航电子 | 1,655,040.98 | 0.06 |
| 19 | 002318 | 久立特材 | 1,651,201.17 | 0.06 |
| 20 | 601988 | 中国银行 | 1,582,839.00 | 0.05 |

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600600 | 青岛啤酒 | 52,709,153.44 | 1.82 |
| 2 | 000895 | 双汇发展 | 48,179,578.33 | 1.66 |
| 3 | 600409 | 三友化工 | 45,369,653.60 | 1.56 |
| 4 | 600068 | 葛洲坝 | 45,252,446.73 | 1.56 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 5 | 000018 | 中冠 A | 11,617,406.83 | 0.40 |
| 6 | 000001 | 平安银行 | 3,954,297.60 | 0.14 |
| 7 | 000750 | 国海证券 | 2,688,919.00 | 0.09 |
| 8 | 000068 | *ST 华赛 | 2,640,426.00 | 0.09 |
| 9 | 600395 | 盘江股份 | 2,375,438.00 | 0.08 |
| 10 | 000933 | 神火股份 | 2,143,393.00 | 0.07 |
| 11 | 002344 | 海宁皮城 | 2,021,340.00 | 0.07 |
| 12 | 601058 | 赛轮金宇 | 2,010,916.00 | 0.07 |
| 13 | 600694 | 大商股份 | 2,000,850.62 | 0.07 |
| 14 | 002081 | 金螳螂 | 1,886,038.00 | 0.07 |
| 15 | 002756 | 永兴特钢 | 1,789,080.00 | 0.06 |
| 16 | 300429 | 强力新材 | 1,776,056.00 | 0.06 |
| 17 | 600077 | 宋都股份 | 1,737,121.00 | 0.06 |
| 18 | 002386 | 天原集团 | 1,688,350.00 | 0.06 |
| 19 | 601633 | 长城汽车 | 1,290,600.00 | 0.04 |
| 20 | 002298 | 鑫龙电器 | 1,197,206.00 | 0.04 |

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 324,030,649.53 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 264,476,929.66 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 111,932,142.30 | 3.86 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 50,115,000.00 | 1.73 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,115,000.00 | 1.73 |
| 4 | 企业债券 | 85,117,544.40 | 2.94 |
| 5 | 企业短期融资券 | 862,902,000.00 | 29.76 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 4,807,196.80 | 0.17 |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|------------------|-------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,114,873,883.50 | 38.45 |

8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 011585003 | 15 北控集 SCP003 | 1,000,000 | 100,440,000.00 | 3.46 |
| 2 | 011510009 | 15 中电投 SCP009 | 1,000,000 | 100,430,000.00 | 3.46 |
| 3 | 011514005 | 15 中粮 SCP005 | 1,000,000 | 100,420,000.00 | 3.46 |
| 4 | 011556003 | 15 中交建 SCP003 | 1,000,000 | 100,380,000.00 | 3.46 |
| 5 | 011517013 | 15 华电 SCP013 | 1,000,000 | 100,320,000.00 | 3.46 |
| 5 | 011599802 | 15 皖交控 SC0003 | 1,000,000 | 100,320,000.00 | 3.46 |

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值或期限套利等操作。基金管理人将充分考虑股指期货

货的收益性、流动性及风险性特征，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，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除山西太钢不锈钢股份有限公司（下称太钢不锈，股票代码：000825）外，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。

根据 2015 年 11 月 26 日太钢不锈《山西太钢不锈钢股份有限公司关于收到太原市环境保护局行政处罚决定书的公告》，公司近日收到太原市环境保护局出具的并环日罚字[2015]001 号及并环日罚字[2015]002 号行政处罚决定书，对我公司的环境违法行为处罚人民币共计 165 万元。

基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

8.12.2

本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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 455,293.84 |
| 2 | 应收证券清算款 | 318,708,696.67 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,131,386.42 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 328,295,376.93 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------|----------|----------------|------------------|---------|---------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 南方利达 A | 544 | 2,889,043.51 | 1,550,547,487.81 | 98.66% | 21,092,181.20 | 1.34% |
| 南方利达 C | 4 | 322,419,642.85 | 1,289,678,571.40 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 548 | 5,221,383.65 | 2,840,226,059.21 | 99.26% | 21,092,181.20 | 0.74% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 南方利达 A | 141,989.39 | 0.0090% |
| | 南方利达 C | - | - |
| | 合计 | 141,989.39 | 0.0050% |

注：1. 分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 南方利达 A | 0 |
| | 南方利达 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开 | 南方利达 A | 10~50 |

| | | |
|-------|--------|-------|
| 开放式基金 | 南方利达 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 南方利达 A | 南方利达 C |
|------------------------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 7 月 8 日）基金份额总额 | 1,685,721,406.28 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 40,000,048,624.89 | 1,289,678,571.40 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 40,114,130,362.16 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,571,639,669.01 | 1,289,678,571.40 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于 2015 年 5 月 29 日发布公告，聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

2015 年 7 月，增聘闫朝女士担任北京银行资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产的诉讼。

报告期内无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 82,000.00 元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | |
|------|--------|----------------|--------------|-----------|------------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 |
| 中信建投 | 2 | 585,885,873.61 | 100.00% | 18,730.83 | 100.00% |
| 中信证券 | 1 | 561.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |

注:交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序:

A: 选择标准

- 1、公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;
- 2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;
- 3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;
- 4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的

渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投 | 264,939,497.38 | 100.00% | 29,120,400,000.00 | 48.56% | 0.00 | 0.00% |
| 中信证券 | 0.00 | 0.00% | 30,843,900,000.00 | 51.44% | 0.00 | 0.00% |