

# 南方成份精选股票型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告日期:2009年8月25日

**81 重要提示**  
基金管理人承诺,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法律责任。本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。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司承诺,于2009年8月21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,保证报告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预示其未来表现。投资者有风险,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。  
本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告自2009年7月1日起至6月30日止。

## 2.1 基金基本情况

基金名称	南方成份精选股票
交易代码	202005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年05月14日
报告期末基金份额总额	15,352,050,445.33

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”。

## 2.2 基金产品说明

**投资目标**  
本基金在保持公司一贯投资管理基础上,通过对宏观经济和上市公司基本面的深入研究和定量定性相结合的方法,精选成份股,寻找驱动力强劲的潜在上市公司,在控制风险的前提下,力争获取超额收益。  
**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,行业增长预期和企业成长预期,通过对行业的深入分析和上市公司基本面的研究,选择预期业绩优秀、估值合理的上市公司进行投资。同时,本基金还将根据对上下游行业运行态势与利益分配等因素的观察,考量行业增长预期,以确定对国民经济主要推动作用或作出重大贡献的行业/产业,从中优选代表基金企业竞争优势,2年内率先突破基金业绩,强调净资产收益率或生命周期上的长期,或短期重大的发展机会,具备超预期增长潜力的上市公司,通过投资此类公司,追求本基金长期超额收益的持续产生。  
**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**  
本基金为股票型基金,属于风险收益比较较高的品种。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名:杨文奎 联系电话:0755-82763888 电子邮箱:manager@southernfund.com	姓名:杨文奎 联系电话:010-66105799 电子邮箱:custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-889-8899	95588
网址	0755-82763889	010-66105798

2.3 基金管理人及基金托管人  
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

## 3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)
本期已实现收益	-623,016,691.04
本期利润	4,287,137,630.64
加权平均基金份额本期利润	0.2702
本期基金份额净值增长率	39.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2009年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0030
期末基金资产净值	14,574,490,502.99
期末基金份额净值	0.9494

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值。仍期末余额,不是当期发生数。  
3.本基金基金业绩指标不包括持有买入返购及交易基金的款项,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

阶段	净值增值/增长率	业绩比较基准	业绩比较基准	①-②	③-④
过去一个月	12.24%	1.04%	11.63%	0.98%	0.61%
过去三个月	19.32%	1.34%	20.74%	1.25%	-1.42%
过去六个月	39.95%	1.53%	56.53%	1.57%	-0.04%
过去一年	7.22%	1.73%	13.59%	2.06%	-6.37%
自基金转型起至今	-5.06%	1.83%	-8.15%	2.10%	3.09%

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

项目	附注	2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2008年6月30日本期余额
一、收入		4,438,673,530.87	-9,805,015,388.64	-
1.利息收入		38,894,111.25	35,424,657.02	-
其中:存款利息收入		1,590,466.09	18,348,937.33	-
债券利息收入		37,303,645.16	15,973,927.15	-
资产支持证券利息收入		-	1,101,792.54	-
其他利息收入		-	-	-
2.投资收益(含公允价值变动)		-510,952,677.75	-4,872,520,688.37	-
其中:股权投资收益		-606,521,656.23	-1,986,457,511.14	-
公允价值变动收益		19,837,913.13	16,111,221.29	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		4,910,154,321.68	-7,975,790,930.57	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)		577,795.69	7,871,573.28	-
二、费用		-151,535,920.23	-306,531,124.78	-
1.管理人报酬	6.4.4.2.1	-93,652,799.34	-166,156,133.41	-
2.托管费	6.4.4.2.2	-15,608,799.97	-27,692,688.86	-
3.销售服务费		-	-	-
4.利息费用		-42,029,371.35	-111,063,909.86	-
5.其他费用		-	-1,362,667.46	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-1,362,667.46	-
6.其他费用		-244,949.57	-256,125.19	-
三、利润总额		4,287,137,630.64	-10,111,546,513.42	-
四、净利润		4,287,137,630.64	-10,111,546,513.42	-

注:1.报告期截止2009年6月30日,基金份额净值0.9494元,基金份额总额15,352,050,445.33份。  
2.后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润分配  
合计:南方成份精选股票型证券投资基金  
本报告期:2009年01月01日至2009年06月30日

项目	附注	2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2008年6月30日本期余额
一、收入		4,438,673,530.87	-9,805,015,388.64	-
1.利息收入		38,894,111.25	35,424,657.02	-
其中:存款利息收入		1,590,466.09	18,348,937.33	-
债券利息收入		37,303,645.16	15,973,927.15	-
资产支持证券利息收入		-	1,101,792.54	-
其他利息收入		-	-	-
2.投资收益(含公允价值变动)		-510,952,677.75	-4,872,520,688.37	-
其中:股权投资收益		-606,521,656.23	-1,986,457,511.14	-
公允价值变动收益		19,837,913.13	16,111,221.29	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		4,910,154,321.68	-7,975,790,930.57	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)		577,795.69	7,871,573.28	-
二、费用		-151,535,920.23	-306,531,124.78	-
1.管理人报酬	6.4.4.2.1	-93,652,799.34	-166,156,133.41	-
2.托管费	6.4.4.2.2	-15,608,799.97	-27,692,688.86	-
3.销售服务费		-	-	-
4.利息费用		-42,029,371.35	-111,063,909.86	-
5.其他费用		-	-1,362,667.46	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-1,362,667.46	-
6.其他费用		-244,949.57	-256,125.19	-
三、利润总额		4,287,137,630.64	-10,111,546,513.42	-
四、净利润		4,287,137,630.64	-10,111,546,513.42	-

注:1.报告期截止2009年6月30日,基金份额净值0.9494元,基金份额总额15,352,050,445.33份。  
2.后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益 基金净值变动表  
会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金  
本报告期:2009年01月01日至2009年6月30日

项目	附注	2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2008年6月30日本期余额
一、期初所有者权益(基金净值)		5,023,636,416.73	5,933,953,434.07	4,986,539,850.80
二、本期损益产生的基金净值变动(本期利润)		4,287,137,630.64	-10,111,546,513.42	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(申购/赎回/转入/转出)		-262,903,829.90	-436,333,148.55	-699,236,978.45
其中:1.基金申购款		47,278,101.78	75,098,111.82	122,376,213.60
2.基金赎回款(以“-”号填列)		-310,181,931.68	-511,431,260.37	-821,613,192.05
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)		4,799,732,586.83	9,784,757,916.16	14,574,490,502.99

注:1.本报告附注为本财务报表的组成部分。  
6.4 本报告期末所有者权益变动表  
会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金  
本报告期:2009年01月01日至2009年6月30日

项目	附注	2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2008年6月30日本期余额
一、期初所有者权益(基金净值)		6,586,147,813.98	23,779,853,418.12	30,365,983,232.10
二、本期损益产生的基金净值变动(本期利润)		-10,111,546,513.42	-10,111,546,513.42	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(申购/赎回/转入/转出)		-1,314,086,930.33	-3,976,652,729.25	-5,290,739,695.98
其中:1.基金申购款		228,469,612.62	739,339,115.08	967,808,728.58
2.基金赎回款(以“-”号填列)		-1,542,556,542.95	-4,715,991,845.21	-6,258,548,388.16
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)		5,272,060,883.65	9,697,636,175.45	14,965,697,059.10

注:1.本报告附注为本财务报表的组成部分。  
6.4.1 本报告期末所有者权益变动表  
本报告期:2009年01月01日至2009年6月30日

项目	附注	2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2008年6月30日本期余额
一、期初所有者权益(基金净值)		5,023,636,416.73	5,933,953,434.07	4,986,539,850.80
二、本期损益产生的基金净值变动(本期利润)		4,287,137,630.64	-10,111,546,513.42	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(申购/赎回/转入/转出)		-262,903,829.90	-436,333,148.55	-699,236,978.45
其中:1.基金申购款		47,278,101.78	75,098,111.82	122,376,213.60
2.基金赎回款(以“-”号填列)		-310,181,931.68	-511,431,260.37	-821,613,192.05
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)		4,799,732,586.83	9,784,757,916.16	14,574,490,502.99

注:1.本报告附注为本财务报表的组成部分。  
6.4.2 本报告期末所有者权益变动表  
本报告期:2009年01月01日至2009年6月30日

项目	附注	2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2008年6月30日本期余额
一、期初所有者权益(基金净值)		6,586,147,813.98	23,779,853,418.12	30,365,983,232.10
二、本期损益产生的基金净值变动(本期利润)		-10,111,546,513.42	-10,111,546,513.42	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(申购/赎回/转入/转出)		-1,314,086,930.33	-3,976,652,729.25	-5,290,739,695.98
其中:1.基金申购款		228,469,612.62	739,339,115.08	967,808,728.58
2.基金赎回款(以“-”号填列)		-1,542,556,542.95	-4,715,991,845.21	-6,258,548,388.16
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)		5,272,060,883.65	9,697,636,175.45	14,965,697,059.10

注:1.本报告附注为本财务报表的组成部分。  
6.4.3 本报告期末所有者权益变动表  
本报告期:2009年01月01日至2009年6月30日

项目	附注	2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2008年6月30日本期余额
一、期初所有者权益(基金净值)		6,586,147,813.98	23,779,853,418.12	30,365,983,232.10
二、本期损益产生的基金净值变动(本期利润)		-10,111,546,513.42	-10,111,546,513.42	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(申购/赎回/转入/转出)		-1,314,086,930.33	-3,976,652,729.25	-5,290,739,695.98
其中:1.基金申购款		228,469,612.62	739,339,115.08	967,808,728.58
2.基金赎回款(以“-”号填列)		-1,542,556,542.95	-4,715,991,845.21	-6,258,548,388.16
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)		5,272,060,883.65	9,697,636,175.45	14,965,697,059.10

注:1.本报告附注为本财务报表的组成部分。  
6.4.4 本报告期末所有者权益变动表  
本报告期:2009年01月01日至2009年6月30日

6.1 资产负债表

会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金  
报告截止日:2009年06月30日

资产	附注	2009年6月30日本期余额	2008年12月31日本期余额
货币资金		117,302,187.77	219,414,442.68
银行存款		21,062,377.92	9,366,113.99
应收款项		8,549,133.77	5,079,565.58
交易性金融资产		14,216,397,165.14	10,835,382,284.23
其中:股票投资		12,682,088,384.54	7,180,277,467.42
债券投资		1,534,308,780.60	3,655,104,796.80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		218,428,242.14	69,410,310.52
应收利息		44,523,732.04	33,100,159.33
应收股利		863,025.35	-
应收申购款		2,075,948.27	576,099.68
其他资产		-	-
资产总计		14,629,203,812.40	11,172,323,955.70

注:1.本报告截止2009年6月30日,基金份额净值0.9494元,基金份额总额15,352,050,445.33份。  
2.后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润分配  
合计:南方成份精选股票型证券投资基金  
本报告期:2009年01月01日至2009年06月30日

项目	附注	2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2009年6月30日本期余额	2008年1月1日至2008年6月30日本期余额
一、收入		4,438,673,530.87	-9,805,015,388.64	-
1.利息收入		38,894,111.25	35,424,657.02	-
其中:存款利息收入		1,590,466.09	18,348,937.33	-
债券利息收入		37,303,645.16	15,973,927.15	-
资产支持证券利息收入		-	1,101,792.54	-
其他利息收入		-	-	-
2.投资收益(含公允价值变动)		-510,952,677.75	-4,872,520,688.37	-
其中:股权投资收益		-606,521,656.23	-1,986,457,511.14	-
公允价值变动收益		19,837,913.13	16,111,221.29	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		4,910,154,321.68	-7,975,790,930.57	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)		577,795.69	7,871,573.28	-
二、费用		-151,535,920.23	-306,531,124.78	-
1.管理人报酬	6.4.4.2.1	-93,652,799.34	-166,156,133.41	-
2.托管费	6.4.4.2.2	-15,608,799.97	-27,692,688.86	-
3.销售服务费				