

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
基金合同生效日期:2012年3月26日

南方绩优成长股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

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法律责任。

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,也不保证基金份额持有人不受损失。

2.1 基金基本情况
基金名称:南方绩优成长股票型证券投资基金
基金简称:南方绩优
基金代码:202003

2.2 基金主要财务指标
截至2011年12月31日,本基金资产净值为1,786,543,544.14元,基金份额净值为1.4707元。

2.3 基金管理人及相关基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文披露网站: http://www.sfnf.com.cn
基金年度报告备置地点:基金管理人、基金托管人办公地址

3.1 主要会计数据和财务指标
2011年 2010年 2009年
基金总资产 712,171,044.59 2,271,662,084.42

3.2 基金净值表现
截至2011年12月31日,本基金基金份额净值为1.4707元,较期初增长14.07%。

3.3 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

3.4 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

3.5 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

3.6 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

3.7 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

3.8 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

3.9 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

3.10 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

3.11 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

3.12 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

3.13 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

3.14 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

3.15 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

3.16 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

3.17 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

3.18 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

3.19 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

3.20 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

3.21 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

3.22 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

3.23 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

3.24 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

2011年,在国内经济增速下降、通胀水平上升的大背景下,受制于偏紧的货币政策以及较高的发行利率,股市市场整体偏弱。全年来看,低估值蓝筹股、石油石化行业以及对经济不敏感的食品饮料行业表现较好;小盘股由于业绩难以得到市场充分认可,表现相对较差。

回顾2011年的操作,一季度绩优成长基金对持仓进行均衡化,增加了低估值蓝筹股;二季度在持仓仓位和个股的调配上,继续加大了对煤炭、食品饮料的配置,取得了一定的超额收益;三季度继续加大蓝筹股的配置,全年整体来看,本基金较好地控制了回撤,实现了较好的风险控制。

4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现
2011年,南方绩优成长基金净值增长率为23.26%,同期业绩比较基准增长率为19.67%。

4.2 报告期内基金的业绩表现
2011年,南方绩优成长基金净值增长率为23.26%,同期业绩比较基准增长率为19.67%。

4.3 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

4.4 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

4.5 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

4.6 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

4.7 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

4.8 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

4.9 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

4.10 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

4.11 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

4.12 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

4.13 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

4.14 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

4.15 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

4.16 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

4.17 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

4.18 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

4.19 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

4.20 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

4.21 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

4.22 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

4.23 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

4.24 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%

4.25 基金投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金股票投资占基金资产净值的比例为78.12%。

4.26 基金持有人户数及持有人结构
截至2011年12月31日,本基金持有人户数为322,150.00户。

4.27 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

注:1. 根据基金管理人南方基金2009年第一次临时股东大会决议以及中国证监会证监许可[2010]1073号,关于核准南方基金管理有限公司变更股权的批复,深圳市投资控股有限公司受让深圳市机场(集团)有限公司持有的南方基金30%的股权,南方基金于2010年9月10日完成了工商变更登记手续。

7.4.1 本报告期及上年度可比期间的关联交易
7.4.1.1 关联交易
7.4.1.2 关联交易
7.4.1.3 关联交易

7.4.1.4 关联交易
7.4.1.5 关联交易

7.4.1.6 关联交易
7.4.1.7 关联交易

7.4.1.8 关联交易
7.4.1.9 关联交易

7.4.1.10 关联交易
7.4.1.11 关联交易

7.4.1.12 关联交易
7.4.1.13 关联交易

7.4.1.14 关联交易
7.4.1.15 关联交易

7.4.1.16 关联交易
7.4.1.17 关联交易

7.4.1.18 关联交易
7.4.1.19 关联交易

7.4.1.20 关联交易
7.4.1.21 关联交易

7.4.1.22 关联交易
7.4.1.23 关联交易

7.4.1.24 关联交易
7.4.1.25 关联交易

7.4.1.26 关联交易
7.4.1.27 关联交易

7.4.1.28 关联交易
7.4.1.29 关联交易

7.4.1.30 关联交易
7.4.1.31 关联交易

7.4.1.32 关联交易
7.4.1.33 关联交易

7.4.1.34 关联交易
7.4.1.35 关联交易

7.4.1.36 关联交易
7.4.1.37 关联交易

7.4.1.38 关联交易
7.4.1.39 关联交易

7.4.1.40 关联交易
7.4.1.41 关联交易

7.4.1.42 关联交易
7.4.1.43 关联交易

7.4.1.44 关联交易
7.4.1.45 关联交易

7.4.1.46 关联交易
7.4.1.47 关联交易

7.4.1.48 关联交易
7.4.1.49 关联交易

7.4.1.50 关联交易
7.4.1.51 关联交易

7.4.1.52 关联交易
7.4.1.53 关联交易

7.4.1.54 关联交易
7.4.1.55 关联交易

7.4.1.56 关联交易
7.4.1.57 关联交易

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 占期初基金资产净值比例

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例. Rows include 招商银行, 工商银行, 浦发银行, etc.

注:买入包括一级市场上申购的买入、新股、增发、配股、换股及行权等获得的股票,卖出金额按成交金额(成交金额=成交数量×成交价格)扣除相关交易费用。

8.4.2 卖出金额占期初基金资产净值2%或前20名的股票卖出
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例. Rows include 中国平安, 招商银行, 民生银行, etc.

注:卖出包括一级市场上申购的买入、新股、增发、配股、换股及行权等获得的股票,卖出金额按成交金额(成交金额=成交数量×成交价格)扣除相关交易费用。

8.4.3 买入股票的公允价值占基金资产净值比例
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票品种, 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 国债, 可转债, 金融债, etc.

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 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. Rows include 1101018, 1101016, 1101022, etc.

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1101028, 1101029, etc.

8.9 投资组合报告附注
8.9.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情况。本基金投资的前十名证券的发行主体均为上市公司。

8.9.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 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. Rows include 1101028, 1101029, etc.

8.9.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 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. Rows include 1101028, 1101029, etc.

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 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. Rows include 1101028, 1101029, etc.

8.9.5 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 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. Rows include 1101028, 1101029, etc.

8.9.6 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 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. Rows include 1101028, 1101029, etc.

8.9.7 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元