

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
报告送出日期:2013年10月24日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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、基金托管人、基金销售机构根据基金合同规定,于2013年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告财务资料未经审计。
本报告日期为2013年7月1日起至2013年9月30日止。

2.1 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 交易代码, 前端交易代码, 后端交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

2.1.1 基金基本情况

基金名称: 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金代码: 519205
基金运作方式: 交易型开放式(ETF)
基金合同生效日: 2013年2月18日
上市日期: 2013年4月11日
基金管理人名称: 南方基金管理有限公司
基金托管人名称: 中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品概况

投资目标: 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略: 本基金以ETF作为其主要投资标的,方便特定的资产通过本基金投资目标ETF。
业绩比较基准: 沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益: -243,757,620.48
2.本期利润: 208,731,490.83
3.加权平均基金份额本期利润: 0.0794
4.期末基金份额净值: 1,937,399,174.18
5.期末基金资产净值: 1,937,399,174.18
6.期末基金份额总额: 688,801

3.2 基金净值表现

注:1.本基金自基金合同生效日(2013年2月18日)至本报告期末未有一笔申购或赎回申请。
2.基金合同关于基金业绩比较基准的约定:本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股的比例不低于基金资产净值的95%。本基金的建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

2013 第三季度 报告

截至报告期末,本基金份额净值为1.0865元,报告期内,份额净值增长率为19.46%,同期业绩比较基准增长率为19.68%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)
1 权益投资: 4,500,591,194.50
2 固定收益投资: 4,500,591,194.50
3 金融衍生品投资: -
4 买入返售金融资产: -
5 银行存款和结算备付金合计: 10,583,919.14
6 其他资产: 9,972,308.61
7 合计: 4,521,147,422.25

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元)
A 农林牧渔: 73,615,793.02
B 采矿业: 78,161,127.45
C 制造业: 2,588,720,803.03
D 电力、热力、燃气及生产和供应业: 183,073,600.53
E 建筑业: 116,128,534.55
F 批发和零售业: 280,230,682.58
G 交通运输、仓储和邮政业: 143,388,319.83
H 住宿和餐饮业: 3,564,062.11
I 信息技术、软件和信息技术服务业: 332,657,123.71
J 金融业: 48,059,178.73
K 房地产业: 403,550,104.97
L 租赁和商务服务业: 52,015,482.78
M 科学研究和技术服务业: 19,005,924.40
N 水利、环境和公共设施管理业: 21,899,338.67
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: 138,171,455.68
S 综合: 16,588,750.26
合计: 4,500,591,194.50

5.3 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股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元)
1 002230 天讯科技: 813,346, 38,731,536.52
2 000053 燕京啤酒: 1,785,654, 36,248,726.20
3 009917 电广传媒: 1,765,979, 33,023,872.30
4 600880 上海医药: 1,090,160, 33,823,272.00
5 000793 华谊兄弟: 2,361,110, 31,048,596.50
6 000400 许继电气: 960,132, 30,770,838.36
7 000661 长春高新: 260,798, 28,768,027.38
8 600867 传化股份: 1,616,714, 28,902,667.82
9 600570 恒生电子: 1,225,885, 26,429,433.80
10 600643 爱建股份: 1,919,025, 24,774,627.55

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)
1 120618 08国债(11): 3,908,810, 3,908,810.60
2 120219 12国债19: 3,700,000, 3,660,000.00
3 122065 11国债(1): 3,540,000, 353,929,200.00
4 120611 08国债(10): 2,700,000, 268,815,000.00

5.5 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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投资股指期货。
5.8.2 本基金投资股指期货的投资策略
本基金的投资策略将根据股指期货的流动性、波动率、相关性等因素进行综合判断,在严格控制风险的前提下,适当参与股指期货投资,以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的头寸,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的交易成本,提高投资效率,达到更好的投资目的。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资国债期货。
5.9.2 本基金投资国债期货的投资策略
注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。
5.10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。
5.10.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 存出保证金: 332,256.88
2 应收证券清算款: 9,629,356.90
3 应收利息: 9,601.50
4 应收股利: 1,093.63
5 其他应收款: -
6 其他流动资产: -
7 待摊费用: -
8 其他资产: 9,972,308.61

5.11 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额: 4,476,093,844.00
报告期间基金份额申购: 62,000,000.00
报告期间基金份额赎回: 362,000,000.00
报告期末基金份额总额: 4,146,093,844.00

5.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

8.1 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.2 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.3 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.4 网站

http://www.nffund.com

8.5 其他

无。

8.6 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.7 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.8 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.9 网站

http://www.nffund.com

8.10 其他

无。

8.11 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.12 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.13 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.14 网站

http://www.nffund.com

8.15 其他

无。

8.16 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.17 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.18 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.19 网站

http://www.nffund.com

8.20 其他

无。

8.21 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.22 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.23 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.24 网站

http://www.nffund.com

8.25 其他

无。

8.26 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.27 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.28 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.29 网站

http://www.nffund.com

8.30 其他

无。

8.31 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.32 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.33 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.34 网站

http://www.nffund.com

8.35 其他

无。

8.36 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.37 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.38 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.39 网站

http://www.nffund.com

8.40 其他

无。

8.41 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.42 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.43 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.44 网站

http://www.nffund.com

8.45 其他

无。

8.46 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.47 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.48 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.49 网站

http://www.nffund.com

8.50 其他

无。

8.51 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.52 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.53 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.54 网站

http://www.nffund.com

8.55 其他

无。

8.56 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.57 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.58 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.59 网站

http://www.nffund.com

8.60 其他

无。

8.61 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.62 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.63 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.64 网站

http://www.nffund.com

8.65 其他

无。

8.66 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.67 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.68 查阅方式

投资者可在办公时间内,持有效身份证件,到下列地址查阅本基金相关资料。

8.69 网站

http://www.nffund.com

8.70 其他

无。

8.71 备查文件目录

- 1. 中国证监会开放式基金信息披露编报规则;
2. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
3. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书;
4. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议;
5. 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013年第三季度报告原文;
6. 深圳证券交易所创业板上市公告书;
7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在编制本报告过程中对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。

8.72 存放地点