



Disclosure 信息披露

2013年10月24日 星期四
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B228

南方成份精选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月24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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,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。
本报告财务资料未经审计,本报告日期为2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方成份精选股票
交易代码	202045
前端交易代码	202055
后端交易代码	202066
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年5月14日
报告期末基金份额总额	9,421,373,993.6份
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,采取定量和定性相结合方式,精选成份股,寻找驱动力的领先上市公司,在控制风险的前提下追求长期超额收益。
投资策略	本基金在保持公司一贯投资管理基础上,紧密把握国际中国经济发展周期,行业增长周期和企业成长周期,通过对行业的深入分析和上市公司基本面分析,主动调整资产配置,力争实现2005年5月-2006年5月期间超额收益目标,根据上下游行业运行态势与利益分配等因素的预测,无偏行业增长预期,以确定性因素和估值优势为主要标准,选择具有成长性的行业/产品,从中优选代表性企业重点投资,2.行业重点型成长企业:跟踪处于成长或成长早期阶段,上游强,或面临重大发展机遇,具备极强增长潜力的上市公司,通过投资研究委员会,进行行业基金投资组合内部跟踪的资产配置"调整。
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。
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: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"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)
1.本期已实现收益	60,411,775.66
2.本期利润	690,275,892.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0718
4.期末基金资产净值	7,097,403,717.56
5.期末基金份额净值	0.8461

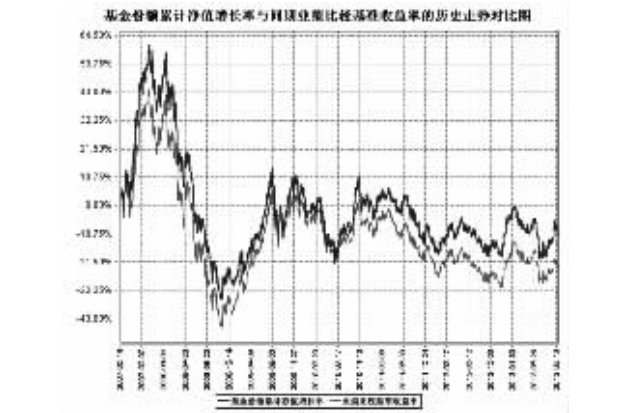
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。2.上述基金业绩指标不包括持有买入返售金融资产和债券投资产生的利息收入,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	9.20%	1.27%	7.70%	1.15%	1.50%	0.12%

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						
---	--	--	--	--	--	--

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的比较



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限		说明
		任职日期	离任日期	
陈健	本基金的基金经理兼联席基金经理	2010年10月16日	-	12

硕士学位,具有基金从业资格。2000年加入南方基金,历任研究发展部基金研究员,2006年12月升任研究员助理兼执行主管,主持工作。2009年11月-2009年6月,任南方基金基金经理,2009年3月-2009年3月,任南方基金基金经理,2009年3月-2006年3月,任南方基金基金经理,2006年3月至2010年10月,任南方基金基金经理,2006年3月至今,任南方基金基金经理,2012年12月至今,任南方基金基金经理。

4.2 管理人及报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方成份精选股票型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定,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,为基金份额持有人谋求最大利益。无报告期内,基金运作运作合规合法无,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例和投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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投资组合。

4.3.2 异常交易专项说明
本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内本基金管理人管理的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2%的交易次数为3次,是由于指数基金跟踪标的指数成份股结构调仓所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
从宏观经济变化来看,自月份开始,主要经济指标如PMI、PPI、用电量、工业增加值和货运量等,均超越市场预期,显示经济回升向好,例如PMI数据回升,且本基金从8月份开始出现了产成品库存环比下降,原材料采购增加,显示销售转好的局面。虽然最新9月PMI数据表现方法低于预期,但是我们认为仍属于扩张区间,且较上月上升四个百分点,同时更进一步的超预期数据如"超预期PMI-产成品库存"和"超预期PMI-产成品库存",反应企业备货积极的同时库存化趋势,显示目前经济成长态势仍属可控。宏观经济的稳定有利于降低通胀,从而支持货币政策平台稳健。从历史数据看,在通胀背景下,配置低估值蓝筹股将能够获得相对大致的超额收益。

因此,报告期内基金在三季度继续采取在沪深300成份股中精选价值个股的投资策略,重点选择低估值、高分红、ROE相对稳定的个股进行重点投资,另一方面,我们对于中期偏短、商业开发、IT设备和信息服务等领域的长期成长型股票也保持适度关注,管理期间一阶段的超额收益主要来源于此。报告期内,基金投资组合表现良好,精选价值蓝筹股的投资策略和资产配置组合表现良好,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在获取相对业绩基准的超额收益同时,相信组合中的各个个股能够给予中短期内有大幅超额回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
3季度内,沪深300指数上涨4.7%,成份精选基金期间净值增长率为2.0%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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 重要提示	
基金管理人的董事会及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责任。	
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月24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。	
基金的过往业绩并不代表其未来表现,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。	
本报告财务资料未经审计,本报告日期为2013年9月30日止。	
§2 基金产品概况	
基金简称	南方多利增强债券
交易代码	202102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月20日
报告期末基金份额总额	1,573,298,966.66份
投资目标	本基金为债券型基金,投资目标是在债券投资组合的基础上,通过股票一级市场申购等手段积极获取收益高于投资基准的收益。
投资策略	1.债券投资策略 首先判断宏观经济形势,在宏观经济分析和行业分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的前提下,配置债券组合的久期和债券组合结构,在久期匹配的基础上,采取自上而下的策略,选择具有成长性的行业/产品,从中优选代表性企业重点投资,2.行业重点型成长企业:跟踪处于成长或成长早期阶段,上游强,或面临重大发展机遇,具备极强增长潜力的上市公司,通过投资研究委员会,进行行业基金投资组合内部跟踪的资产配置"调整。
业绩比较基准	本基金为债券型基金,属于风险收益比较低的品种。
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
下属同属基金的资金简称	南方多利增强债券A
下属同属基金的交易代码	202103
报告期末下属同属基金份额总额	819,187,174.36份

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损益。
2.上述基金业绩指标不包括持有买入返售金融资产和债券投资产生的利息收入,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。
3.本基金自2009年9月25日起增加收取销售费,原有收费模式保持不变。

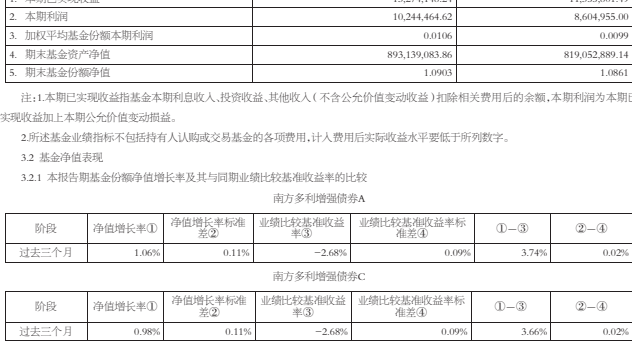
§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)
1.本期已实现收益	13,274,146.24
2.本期利润	10,244,644.2
3.加权平均基金份额本期利润	0.0106
4.期末基金资产净值	803,139,083.86
5.期末基金份额净值	1.0901

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损益。
2.上述基金业绩指标不包括持有买入返售金融资产和债券投资产生的利息收入,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。
3.本基金净值表现
3.2.1 报告期末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	净值增长率①	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	1.06%	0.11%	-2.68%	0.09%	3.74%	0.02%

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的比较



阶段	净值增长率①	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	0.98%	0.11%	-2.68%	0.09%	3.66%	0.02%

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,746,187,903.27	84.39
	其中:股票	6,746,187,903.27	84.39
2	固定收益投资	56,754,583.00	7.01
	其中:债券	56,754,583.00	7.01
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	619,672,088.76	7.75
	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	56,807,144.83	0.71
6	其他资产	10,242,112.44	0.13
7	合计	7,993,663,832.30	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	555,699,429.37	6.97
C	制造业	1,903,573,552.82	23.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,825,579.99	0.21
E	建筑业	781,748,140.90	9.81
F	批发和零售业	83,259,014.24	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	608,189,873.84	7.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	133,388,499.13	1.67
J	金融业	1,576,265,974.03	19.26
K	房地产业	909,613,480.19	11.41
L	租赁和商务服务业	81,262,034.06	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	372,164,702.40	4.67
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	750,549.54	0.01
S	综合	3,591,353.76	0.05
合计	-	6,746,187,903.27	84.63

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十名股票投资明细					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601328	交通银行	148,133,422	636,973,714.60	7.99
2	601668	中国建筑	195,259,826	626,736,439.72	7.89
3	601006	大秦铁路	88,716,254	587,614,329.12	7.37
4	000002	万科A	47,897,819	437,307,087.47	5.49
5	600928	中国石化	90,022,665	403,696,632.60	5.06
6	600741	华谊集团	41,050,356	381,769,762.40	4.79
7	000069	华侨城A	64,166,326	372,164,702.40	4.67
8	600266	北京城建	35,081,142	367,659,368.16	4.61
9	600036	招商银行	20,095,408	347,723,614.60	4.39
10	600194	上海集团	19,998,084	288,397,676.52	3.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	538,777,000.00	6.76
	其中:政策性金融债	538,777,000.00	6.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	21,977,883.00	0.28
8	其他	-	-
9	合计	560,754,883.00	7.03

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债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120245	12国债开45	1,500,000	149,790,000.00	1.88
2	120218	12国债开18	1,400,000	139,062,000.00	1.74
3	130322	13进出22	1,000,000	100,070,000.00	1.26
4	120236	12国债开36	1,000,000	99,570,000.00	1.25
5	090224	09国债24	500,000	49,985,000.00	0.63

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
注: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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资股指期货。
5.9 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。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到过公开谴责、处罚的情况。
5.10.2
本基金本报告期末持有的十只股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,770,632.86
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	8,247,307.45
5	应收中票利息	224,172.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,242,112.44

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	21,849,552.90	0.27
2	110023	民生转债	128,030.10	0.00

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

报告期末基金份额总额	8,839,570,262.68
报告期末基金份额中申购份额	53,132,057.34
减:报告期末基金份额赎回份额	47,128,326.06
报告期末基金份额总额	9,421,373,993.96

§7 基金管理人、基金托管人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

- 1.《南方成份精选股票型证券投资基金合同》;
- 2.《南方成份精选股票型证券投资基金托管协议》;
- 3.《南方成份精选股票型证券投资基金招募说明书》;
- 4.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告》;
- 5.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 6.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 7.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 8.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 9.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 10.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;

§9 基金管理人、基金托管人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§10 备查文件目录

- 1.《南方成份精选股票型证券投资基金合同》;
- 2.《南方成份精选股票型证券投资基金托管协议》;
- 3.《南方成份精选股票型证券投资基金招募说明书》;
- 4.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告》;
- 5.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 6.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 7.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 8.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 9.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;
- 10.《南方成份精选股票型证券投资基金2013年3季度报告摘要》;

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

注:本基金管理人、基金托管人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

南方积极配置证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月24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。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,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。
本报告财务资料未经审计,本报告日期为2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方积极配置股票(LOF)
交易代码	160105
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2004年10月14日
报告期末基金份额总额	1,467,620,328.50份
投资策略	本基金为股票型基金,通过积极配置进行资产配置和资产配置,在控制风险的前提下追求长期超额收益。
业绩比较基准	本基金为股票型基金,通过积极配置进行资产配置和资产配置,在控制风险的前提下追求长期超额收益。
风险收益特征	本基金为股票型基金,通过积极配置进行资产配置和资产配置,在控制风险的前提下追求长期超额收益。
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: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"南方积极"。

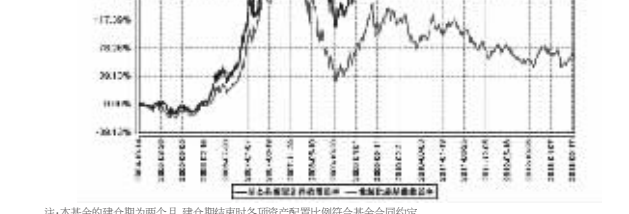
§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)
1.本期已实现收益	30,178,755.32
2.本期利润	125,402,412.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0809
4.期末基金资产净值	1,496,774,975.61
5.期末基金份额净值	1.0199

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损益。
2.上述基金业绩指标不包括持有买入返售金融资产和债券投资产生的利息收入,计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。
3.2.1 基金净值表现
3.2.1 报告期末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	净值增长率①	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	8.65%	1.03%	8.43%	0.97%	0.22%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效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的比较



注:本基金建仓期为两个月,建仓结束后各项资产配置比例符合基金合同约定。

李海潮	2010年1月30日	-	12	<p>岭证券股份有限公司投资管理部及证券投资部;2002年起进入基金行业,历任万家基金管理有限公司(原天同基金管理有限公</p> <p>究部副高级经理、基金管理部基金经理;2004年9月至2005年10月</p> <p>万家瑞兴收益债券型证券投资基金(原天同保本增值证券投资基金);2006年7月至2007年7月任万家丰收收益货币</p> <p>基金基金经理;2006年2月至2009年8月,任万家和谐增长灵活</p> <p>混合型证券投资基金基金经理;2008年7月至2009年8月,任申</p> <p>鹏睿奇保本股票证券投资基金基金经理;2009年8月,加入</p>
-----	------------	---	----	---