

## 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  
报告送达日期:2013年10月24日

**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会及监察稽核部对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信息,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财产,但不保证基金一定盈利。  
基金的过往业绩并不代表未来表现,投资有风险,请在作出投资决策前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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

**1.2 基金产品概况**

基金简称	南方成份精选股票
交易代码	200605
份额单位代码	200605
基金管理人代码	200606
基金托管人代码	200606
基金合同生效日	2007年10月14日
报告期末基金资产总额	9,423,373,993.96元
投资目标	本基金在充分考虑公司、行业特征的基础上,通过行业甄别和上市公司基本面的深入研究,采用定性分析和定量分析相结合的方法,寻找投资于行业的领先上市公司,把握投资风格的前奏,寻求超额收益。
投资策略	本基金将充分考虑公司、行业特征的基础上,通过行业甄别和上市公司基本面的深入研究,采用定性分析和定量分析相结合的方法,寻找投资于行业的领先上市公司,把握投资风格的前奏,寻求超额收益。
业绩比较基准	80%×深证300指数+20%×业绩报酬
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于风险收益比较高的品种。
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平台上,简称为“南方成份”。

**1.3 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	699,273,892.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0718
4.期末基金份额净值	7,971,493,717.56
5.期末基金净值	0.8461

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、按权责发生制计算的手续费收入、其他收入(不含公允价值变动收益的摊销)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.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计价费用影响收益水平要低于所列数字。

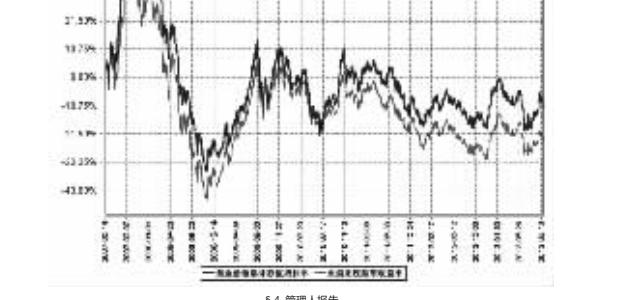
3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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

过去三个月 9.20% 1.27% 7.76% 1.15% 1.50% 0.12%

3.2.2 自基金成立以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**4.1 管理人报告**

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
陈健	本基金的基金经理及投资决策委员会委员	2010年10月16日 -	12	硕士学历,具有基金从业资格,2000年加入南方基金,历任行业研究员、基金经理助理,2009年12月至今,担任基金经理执行董事,主管工作。2003年11月-2005年6月,任行业研究员;2005年6月-2007年1月,任行业研究员兼基金经理助理;2007年1月-2006年3月,任行业研究员兼基金经理助理;2006年3月-2008年2月,任行业研究员兼基金经理助理;2008年2月-2010年10月,任行业研究员兼基金经理助理;2010年10月-2012年12月,任行业研究员兼基金经理助理;2012年12月至今,任南方安心基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的说明

本报告期内,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》等法律法规及各自实施细则、《南方成份精选股票型证券投资基金合同》以及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,力求取得良好的投资收益。本基金的过往业绩并不代表未来表现,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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行的情况

本报告期内,基金管理人严格执行《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》等法律法规及各自实施细则、《南方成份精选股票型证券投资基金合同》以及其他有关法律法规的规定,在公平交易制度上不存在不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金未在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交

易的单边交易量或者单边成交金额占比均未超过1%,由于指数基金根据指数的构成比例被动购买或出售股票,导致本基金的

4.4 报告期内基金的业绩表现

3季度末,沪深300下跌47.4%,成份精选基金区间净值增长-9.20%。

4.5 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  
报告送达日期:2013年10月24日

**5.1 重要提示**

基金管理人的董事会及监察稽核部对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信息,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未来表现,请在作出投资决策前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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

**5.2 基本产品概况**

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  
报告送达日期:2013年10月24日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及监察稽核部对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信息,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未来表现,请在作出投资决策前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2013年7月1日起至2013年9月30日止。

**5.3 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 699,273,892.53

3.加权平均基金份额本期利润 0.0718

4.期末基金份额净值 7,971,493,717.56

5.期末基金净值 0.8461

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、按权责发生制计算的手续费收入、其他收入(不含公允价值变动收益的摊销)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.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计价费用影响收益水平要低于所列数字。

**5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合**

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 560,54,583.00 7.01

其中:债券 560,54,583.00 7.01

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:买断式回购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 10,342,112.44 0.13

7 合计 7,993,663,323.36 100.00

注:本基金的股票投资组合由深证成份指数构成。

**5.5 报告期末按公允价值排序的前五名股票投资组合**

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林、牧、渔业 - -

2 采矿业 555,699,129.37 6.97

3 制造业 1,903,573,552.82 23.88

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 16,820,579.09 0.21

5 建筑业 781,748,140.90 9.81

6 银行 83,259,044.24 1.04

7 交通运输、仓储和邮政业 608,189,733.84 7.63

8 信息技术业 133,388,499.15 1.67

9 金属、非金属矿物业 1,376,265,074.03 17.26

10 采掘业 909,613,440.19 11.41

11 航空、航天器及设备业 812,663.04 0.01

12 科学、技术服务业 41,050,936.52 0.50

13 计算机、通信和其他电子设备制造业 372,164,702.40 4.67

14 其他制造业 35,081,142.42 4.61

15 电力、煤气及水的生产和供应业 29,095,305 3.99

16 银行业 19,998,084 3.24

17 其他服务业 3,901,553.76 0.05

18 其他 6,746,187,903.27 84.63

注:本基金的股票投资组合由深证成份指数构成。

**5.6 报告期末按公允价值排序的前五名贵金属投资组合**

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 买入返售金融资产 - -

2 其他 - -

3 其他 - -

4 其他 - -

5 其他 - -

6 其他 - -

7 其他 - -

8 其他 - -

9 其他 - -

10 其他 - -

11 其他 - -

12 其他 - -

13 其他 - -

14 其他 - -

15 其他 - -

16 其他 - -