

信息披露 Disclosure

南方盛元红利股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

注1: 根据本基金合同, 封闭期内, 本基金大类资产投资的比例为: 股票60%-100%、债券、货币市场工具及其他金融工具10%-40%、权证0-3%、资产支持证券0-20%、现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例最高可以达到为30%; 封闭期届满转型为开放式基金后, 本基金大类资产投资的比例为: 股票60%-95%、债券、货币市场工具及其他金融工具0-35%、权证0-3%、资产支持证券占基金资产净值的0-20%、现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于本基金资产净值的5%。根据相关法律法规和基金合同, 本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月。建仓期结束时, 本基金各项资产配置比例达到基金合同约定的。

2. 本基金的业绩比较基准为90% × 上证红利指数 + 10% × 上证国债指数。

4 管理人报告

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	证券从业年限	说明
张旭	本基金的基金经理	2012年11月23日	-	6年

张旭, 毕业于中央财经大学, 获金融学硕士学位, 注册金融分析师 (CFA), 具有多年证券从业经历。2008年加入南方基金, 曾任金融及房地产行业研究员, 金融策略研究员, 南方盛元红利股票型证券投资基金基金经理。2012年11月至, 任南方盛元红利股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规, 中国证监会和《南方盛元红利股票型证券投资基金基金合同》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。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及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

本报告期内, 本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人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和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为2次, 是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

我们认为, 指数化投资不同于主动式投资, 后者强调通过各自不同的投资理念去寻找超越市场的投资机会, 而前者的宗旨是尽量复制标的指数的走势, 为投资者提供一个跟踪指数化的投资工具。我们专门针对ETF及联接基金的投资策略进行了科学、严谨的论证, 并制定了相应的风险控制措施, 确保基金资产的安全。我们已在本时点不断完善相关工作。ETF及联接基金管理团队除基金治理之外, 还由数量投资分析师、交易员、IT人员等组成, 为基金的投资管理提供研究、交易、系统及相关工作的快速支持保障。

对于本基金而言, 本报告期跟踪误差的主要来源包括: ①本基金自身接受申购赎回所导致的成份股权重调整, 对此我们通过对每日反向交易量控制跟踪误差最小化; ②本基金大额申购赎回对ETF所带来的成份股权重调整, 对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对; ③指数成份股调整所带来的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自基金成立以来至本报告期末的跟踪误差跟踪, 相对于业绩基准的年化跟踪误差为0.652%, 较好的完成了《基金合同》中约定的跟踪误差控制目标。截至本报告期末, 本基金份额净值为0.6558元, 报告期内, 份额净值增长率为9.74%, 同期业绩基准增长率为9.65%。

本基金为指数化产品, 作为基金管理人, 我们将通过严格的投资管理流程, 精确的数量化计算, 精益求精的工作态度, 恪守诚信化投资宗旨, 实现对标的指数的有效跟踪, 为持有人提供与相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格, 借助投资本基金参与市场。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,997,023.87	0.29
其中: 股票		2,997,023.87	0.29
2	基金投资	97,459,271.40	94.06
3	固定收益投资	-	-
其中: 债券		-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中: 买断式回购的买入返售金融资产		-	-
7	银行存款和结算备付金合计	58,303,621.57	5.63
8	其他资产	145,319.39	0.01
9	合计	1,035,055,236.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-	0.00
B	采矿业	-	-	0.00
C	制造业	-	-	0.15
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-	0.00
E	建筑业	-	-	0.04
F	批发和零售业	-	-	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	0.00
J	金融业	-	-	0.03
K	房地产业	-	-	0.03
L	租赁和商务服务业	-	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-	0.00
P	教育	-	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-	0.00
S	综合	-	-	0.00
合计			2,997,023.87	0.29

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	002024	苏宁易购	50,360	334,568.00	0.04
2	002081	金耀华	19,850	384,494.00	0.04
3	002026	华仪股份	11,601	319,839.57	0.03
4	002241	聚龙股份	9,196	253,404.00	0.02
5	000792	盐湖股份	9,200	168,560.00	0.02
6	000002	万科A	17,181	157,721.58	0.02
7	000051	格力电器	4,328	120,015.44	0.01
8	000001	平安银行	9,961	101,004.54	0.01
9	000858	五粮液	4,248	78,460.56	0.01
10	000024	招商地产	5,788	71,134.52	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: 本基金本报告期末未持有债券。

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

注: 本基金本报告期末未持有债券。

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贵金属投资明细

注: 本基金本报告期末未持有贵金属。

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 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.11 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。

5.12 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。

5.13 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。

5.14 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.15 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。

5.16 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.17 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。

5.18 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.19 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。

5.20 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.21 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。

5.22 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.23 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。

5.24 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.25 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。

5.26 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.27 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。

5.28 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.29 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。

5.30 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,647,825,387.01	91.80
其中: 股票		1,647,825,387.01	91.80
2	固定收益投资	70,035,000.00	3.90
其中: 债券		70,035,000.00	3.90
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中: 买断式回购的买入返售金融资产		-	-
6	银行存款和结算备付金合计	71,425,464.45	3.98
7	其他资产	5,771,703.33	0.32
8	合计	1,795,057,554.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-	5.76
B	采矿业	-	-	10.75
C	制造业	-	-	52.04
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-	1.08
E	建筑业	-	-	0.06
F	批发和零售业	-	-	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-	1.04
H	住宿和餐饮业	-	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	12.71
J	金融业	-	-	0.00
K	房地产业	-	-	3.77
L	租赁和商务服务业	-	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-	1.58
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-	-
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	-	-	-
S	综合	-	-	0.39
合计			1,647,825,387.01	92.39

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	300157	恒康艾普	5,809,244	104,159,744.92	5.84
2	000992	平遥发展	2,000,942	102,304,566.74	5.76
3	002445	中微电子	3,499,951	68,494,041.07	3.84
4	300010	立思辰	2,099,960	59,219,125.80	3.32
5	300047	天富集团	2,999,994	52,019,895.96	2.92
6	300151	昌红科技	2,599,928	49,996,615.44	2.80
7	300063	天龙集团	3,000,061	49,050,997.35	2.75
8	002296	祥信科技	1,480,043	46,991,365.25	2.63
9	002153	石基信息	599,932	42,097,228.44	2.36
10	601028	华友股份	2,599,979	41,209,667.15	2.31

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: 本基金本报告期末未持有债券。

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

注: 本基金本报告期末未持有债券。

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贵金属投资明细

注: 本基金本报告期末未持有贵金属。

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 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.11 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。

5.12 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.13 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。

5.14 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.15 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。

5.16 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.17 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。

5.18 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.19 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。

5.20 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.21 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。

5.22 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.23 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。

5.24 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.25 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。

5.26 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.27 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。

5.28 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.29 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。

5.30 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.31 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。

5.32 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注: 本基金本报告期内未投资期权。

5.33 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。