

南方成份精选股票型证券投资基金

2014 年 度 报 告 摘 要

基金经理可与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金合同约定,本基金收益分配原则为:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的90%;若《基金合同》生效不满6个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式有两种:现金分红和红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者选择不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红,但未除权的基金份额赎回方式是红利再投资;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本基金于2015年1月16日进行本基金的2014年度收益分配(每10份基金份额派发红利2.80元)。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
无。

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况说明
本基金托管人,本基金托管人在对南方成份精选股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金基金份额持有人的利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,南方成份精选股票型证券投资基金的托管人——南方基金管理有限公司在南方成份精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的有关规定进行。

5.3 托管人对年度报告中财务信息真实、准确和完整发表意见
本托管人根据南方成份精选股票型证券投资基金的托管人职责,对南方成份精选股票型证券投资基金2014年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 审计报告
本基金2014年度财务报告审计报告经普华永道中天会计师事务所特殊普通合伙审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2015)第0353号“标准无保留意见”的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7 年度财务报表
7.1 资产负债表
会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金
会计截止日:2014年12月31日

资产	期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
货币资金	485,409,071.07	37,956,923.97
结算备付金	13,706,635.63	13,578,326.72
存出保证金	1,254,237.48	1,878,739.38
交易性金融资产	8,670,739,372.88	7,616,203,451.23
其中:股票投资	8,577,448,226.80	7,167,361,145.43
基金投资	—	—
债券投资	293,253,136.08	448,932,305.80
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	1,500,500,000.00	250,000,000.00
应收证券清算款	690,616,396.13	357,955,945.44
应收利息	6,985,019.21	6,864,382.45
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
预付账款	41,329,726.99	78,929.58
其他资产	—	—
资产总计	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77

负债和所有者权益	期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
应付证券清算款	39,923,357.00	—
应付赎回款	1,089,366,007.89	6,992,396.10
应付管理人报酬	13,306,176.24	10,193,646.06
应付托管费	—	1,698,941.94
应付销售服务费	2,217,606.04	—
应付交易费	7,041,498.99	3,134,505.87
应付税费	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
其他负债	4,011,599.01	743,834.23
负债合计	1,150,066,335.17	22,763,325.26
所有者权益:		
实收资本	2,416,065,493.71	2,558,497,633.52
未分配利润	7,838,468,938.51	4,880,989,251.99
所有者权益合计	10,254,474,124.22	7,939,877,583.51
负债和所有者权益总计	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.3242元,基金份额总额7,743,948,806.03份。

7.2 利润表
会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、营业收入	4,349,183,804.53	-488,281,585.03
1.利息收入	26,996,201.24	31,569,903.63
其中:存款利息收入	1,438,825.85	2,287,026.83
债券利息收入	16,335,218.22	16,627,191.38
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	8,092,247.22	12,654,645.75
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,543,285,103.28	852,905,097.11
其中:股票投资收益	1,276,496,851.75	35,295,522.54
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	1,141,195.62	2,091,062.63
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
公允价值变动收益	—	—
其他收益	265,647,055.91	265,633,511.92
3.公允价值变动损益(损失以“-”号填列)	2,778,316,161.38	-873,512,498.41
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,516,393.63	756,752.31
减:营业费用	160,254,581.10	171,843,409.94
二、利润总额	10,254,094,155.18	126,818,500.45
三、净利润	19,553,041.55	21,103,887.38
1.净利润	—	—
2.其他综合收益	—	—
三、其他综合收益	—	—
四、利润总额	10,254,094,155.18	126,818,500.45
五、净利润	19,553,041.55	21,103,887.38

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.3242元,基金份额总额7,743,948,806.03份。

7.3 所有者权益变动表
会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、所有者权益(基金净值)变动表		
1.期初余额	2,558,497,633.52	2,558,497,633.52
2.本期增减变动金额	7,838,468,938.51	4,880,989,251.99
3.期末余额	10,397,146,572.03	7,439,486,885.51

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.3242元,基金份额总额7,743,948,806.03份。

7.4 利润分配表
会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
二十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
三十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
四十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
五十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
六十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
七十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
八十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十一、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十二、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十三、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十四、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十五、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十六、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十七、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十八、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
九十九、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77
一百、可供分配利润	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.3242元,基金份额总额7,743,948,806.03份。

7.5 现金流量表
会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

其他负债	1,011,599.01	743,834.23
负债合计	1,156,066,335.17	22,763,323.26
所有者权益：		
实收资本	2,416,065,493.71	2,958,497,633.52
资本公积	7,838,408,630.51	4,980,389,951.09
未分配利润	10,254,474,124.22	7,939,467,385.51
负债和所有者权益总计	11,410,540,459.39	7,962,250,908.77

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	485,409,071.07	1,264,710.57	37,956,923.97	1,944,700.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。
7.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
注：无。