# 深证成份交易型开放式指数证券投资基金

## 【2015】第三季度报告

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:2015年10月27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2015年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 南方深证成份ETF |
| 场内简称 | 深成ETF |
| 交易代码 | 159903 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年12月4日 |
| 报告期末基金份额总额 | 553,154,507.00份 |
| 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 | 本基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。<br>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。<br>如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布,或深证成份指数由其他指数替代,或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 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"深成ETF"

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -89,649,627.47 |
| 2.本期利润 | -237,734,133.13 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.4140 |
| 4.期末基金资产净值 | 580,863,583.05 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0501 |

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收益。

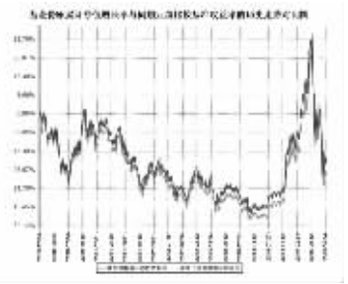
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -28.93% | 3.47% | -30.34% | 3.60% | 1.41% | -0.13% |

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变动的比较



§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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 柯晓 | 本基金基金经理 | 2013年4月22日 | - | 18年 | 美国纽约大学工商管理硕士,具有基金从业资格。曾先后担任美国美林证券公司助理副总裁、招商证券首席产品策略师。2006年加入南方基金,任首席产品设计师;2010年8月至今,任小康ETF及南方小康基金经理;2013年4月至今,任南方深成及南方深成ETF的基金经理;2013年5月至今,任南方上证380ETF及联接基金的基金经理;2015年7月至今,任南方互联基金的基金经理。 |

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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》,《公开募集证券投资基金运作管理办法》,《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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,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规定。

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5次,其中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,2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

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

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拟合标的指数的走势,为投资者提供一个跟踪指数的投资工具。同时,ETF基金又不同于普通指数基金,由于ETF的可上市交易属性,全市场的投资者都将根据基金管理人每日公告的申购赎回清单进行申赎及跨市场操作,这就使得ETF基金管理人必须更加注重风险控制,一丝疏漏都可能导致严重的后果。也正因为深知此理,我们专门针对ETF的投资管理制定了科学、严谨的操作流程,使得流程中的每位人员,都清楚的知道自己在什么时点需要完成什么工作。ETF管理团队除基金经理之外,还由数量投资分析师、交易管理人员、IT人员等组成,为ETF基金的投资管理提供研究、交易、系统及其相关工作的快速支持响应。

对于本基金而言,本报告期跟踪误差的主要来源包括:①大额申购赎回(如联接基金的大比例换购)所带来的成份股权重偏离,对此我们采取了优化的"再平衡"操作进行应对;②指数成份股调整所带来的跟踪误差是不容忽视的,是本基金跟踪误差的另一主要来源。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自上市日至本报告期末的指数跟踪期间,相对于标的指数的年化跟踪误差为0.871%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过2%的投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为1.0501元,报告期内,份额净值增长率为-28.93%,同期业绩基准增长率为-30.34%。

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、恪守指数化投资的宗旨,实现对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之相近的收益。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。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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 | 560,557,954.09 | 96.28 |
| | 其中:股票 | 560,557,954.09 | 96.28 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 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 | 21,508,760.92 | 3.69 |
| 7 | 其他资产 | 136,678.06 | 0.02 |
| 8 | 合计 | 582,203,393.07 | 100.00 |

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

| 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 | 5,888,506.50 | 1.01 |
| B | 采掘业 | 9,518,431.76 | 1.64 |
| C | 制造业 | 318,963,120.30 | 54.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,984,824.60 | 2.06 |
| E | 建筑业 | 10,092,652.80 | 1.74 |
| F | 批发和零售业 | 17,816,515.72 | 3.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,256,656.00 | 0.56 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 66,121,535.25 | 11.38 |
| J | 金融业 | 35,348,878.29 | 6.09 |
| K | 房地产业 | 36,779,526.35 | 6.33 |
| L | 租赁和商务服务业 | 14,682,062.44 | 2.53 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,639,347.00 | 0.28 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 10,207,475.45 | 1.76 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 3,393,418.30 | 0.58 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 12,664,802.72 | 2.18 |
| S | 综合 | 2,196,671.81 | 0.38 |
| | 合计 | 560,554,425.29 | 96.50 |

5.2.2 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 | 000002 | 万科A | 1,040,358 | 13,243,757.34 | 2.28 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 558,740 | 9,040,413.20 | 1.56 |
| 3 | 000001 | 平安银行 | 768,310 | 8,059,571.90 | 1.39 |
| 4 | 000725 | 京东方A | 2,867,342 | 7,999,884.18 | 1.38 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 249,038 | 6,283,228.74 | 1.08 |
| 6 | 002024 | 苏宁云商 | 514,651 | 6,237,570.12 | 1.07 |
| 7 | 000917 | 电广传媒 | 137,200 | 5,876,276.00 | 1.01 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 160,214 | 5,219,772.12 | 0.90 |
| 9 | 000024 | 招商地产 | 178,970 | 5,098,855.30 | 0.88 |
| 10 | 300104 | 乐视网 | 117,162 | 4,789,582.56 | 0.82 |

5.3.2 报告期末积极投资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

注:本基金本报告期未持有积极投资。

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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 134,387.67 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,290.39 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 136,678.06 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000917 | 电广传媒 | 5,876,276.00 | 1.01 | 重大事项停牌 |

注:本基金截至2015年9月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末持有积极投资。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 634,154,507.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 225,000,000.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 306,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 553,154,507.00 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同。

2、深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议。

3、深证成份交易型开放式指数证券投资基金2015年3季度报告原文。

8.2 存放地点

深圳市福田中心区福华1路6号免税商务大厦31至33楼

8.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

# 南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 【2015】第三季度报告

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:2015年10月27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2015年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 南方深证成份ETF联接 |
| 交易代码 | 202017 |
| 前端交易代码 | 202017 |
| 后端交易代码 | 202018 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年12月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 405,248,046.08份 |
| 投资目标 | 通过投资于深成ETF,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 | 本基金为完全被动式指数基金,以深成ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资深成ETF。本基金并不参与深成ETF的管理。<br>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于深成ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。<br>在正常市场情况下,本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 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"南方深成"。

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 深证成份交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 159903 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年12月4日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2010年2月2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 |

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"深成ETF"。

2.1.2 目标基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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 | 本基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。<br>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布,或深证成份指数由其他指数替代,或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 9,173,514.70 |
| 2.本期利润 | -129,314,167.39 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.3089 |
| 4.期末基金资产净值 | 326,740,235.62 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.8063 |

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收益;

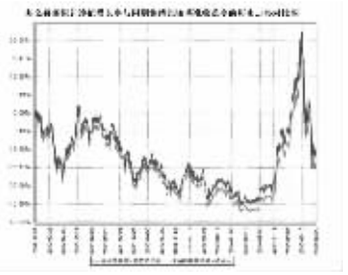
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -27.15% | 3.26% | -28.92% | 3.42% | 1.77% | -0.16% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 柯晓 | 本基金基金经理 | 2013年4月22日 | - | 18年 | 美国纽约大学工商管理硕士,具有基金从业资格。曾先后担任美国美林证券公司助理副总裁、招商证券首席产品策略师。2006年加入南方基金,任首席产品设计师;2010年8月至今,任小康ETF及南方小康基金经理;2013年4月至今,任南方深成及南方深成ETF的基金经理;2013年5月至今,任南方上证380ETF及联接基金的基金经理;2015年7月至今,任南方互联基金的基金经理。 |

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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规定。

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5次,其中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,2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

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

三季度,在部分股票估值水平较高,杠杆盘爆仓等因素影响下,市场快速下跌,在股价泥沙俱下之后,一些优质标的投资价值更加明显,值得深入挖掘布局。

三季度本基金继续围绕改革红利、转型创新的投资主线布局。在中国大国崛起的历史背景下,深化改革带来的政策红利提高了经济效率,激发了企业活力,我们会自上而下配置受益于改革红利的优势产业,在这些产业中自下而上精选富有活力和格局远大的企业,努力为广大投资者创造回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.111元,报告期内,份额净值增长率为-32.60%,同期业绩基准增长率为-27.60%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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 | 7,886,955.91 | 2.41 |
| | 其中:股票 | 7,886,955.91 | 2.41 |
| 2 | 基金投资 | 299,616,035.74 | 91.60 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 19,183,379.99 | 5.87 |
| 8 | 其他资产 | 395,169.30 | 0.12 |
| 9 | 合计 | 327,081,540.94 | 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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 38,076.00 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 56,727.44 | 0.02 |
| C | 制造业 | 4,219,796.26 | 1.29 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,276.00 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 161,149.25 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | 170,579.80 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,654.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 888,746.90 | 0.27 |
| J | 金融业 | 71,796.04 | 0.02 |
| K | 房地产业 | 1,294,110.67 | 0.40 |
| L | 租赁和商务服务业 | 341,398.70 | 0.10 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 32,310.00 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 196,391.29 | 0.06 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,764.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 293,516.56 | 0.09 |
| S | 综合 | 101,664.00 | 0.03 |
| | 合计 | 7,886,955.91 | 2.41 |

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 | 000024 | 招商地产 | 38,451 | 1,095,468.99 | 0.34 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 10,674 | 347,758.92 | 0.11 |
| 3 | 002183 | 怡亚通 | 5,000 | 216,950.00 | 0.07 |
| 4 | 000650 | 仁和药业 | 23,400 | 198,666.00 | 0.06 |
| 5 | 000793 | 华闻传媒 | 19,800 | 190,674.00 | 0.06 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 6,989 | 179,826.97 | 0.06 |
| 7 | 000917 | 电广传媒 | 8,600 | 165,722.00 | 0.05 |
| 8 | 002308 | 威创股份 | 11,700 | 164,385.00 | 0.05 |
| 9 | 000839 | 中信国安 | 7,000 | 163,590.00 | 0.05 |
| 10 | 300070 | 碧水源 | 3,544 | 154,837.36 | 0.05 |

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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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。

5.9 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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 南方深证成份ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 南方基金管理有限公司 | 299,616,035.74 | 91.70 |

5.10 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。

5.11 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 投资组合报告附注

5.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 261,033.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,608.94 |
| 5 | 应收申购款 | 120,099.16 |
| 6 | 其他应收款 | 10,427.90 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 395,169.30 |

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002183 | 怡亚通 | 216,950.00 | 0.07 | 重大事项停牌 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 179,826.97 | 0.06 | 重大事项停牌 |
| 3 | 000917 | 电广传媒 | 165,722.00 | 0.05 | 重大事项停牌 |
| 4 | 000839 | 中信国安 | 163,590.00 | 0.05 | 重大事项停牌 |
| 5 | 300070 | 碧水源 | 154,837.36 | 0.05 | 重大事项停牌 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 455,299,871.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 31,913,531.91 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 81,965,356.83 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期末基金份额总额 | 405,248,046.08 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。

2、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》。

3、南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金2015年第3季度报告原文。

8.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路6号免税商务大厦31-33楼

8.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

# 南方盛元红利混合型证券投资基金

## 【2015】第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 南方盛元红利混合 |
| 场内简称 | 南方盛元 |
| 交易代码 | 202009 |
| 前端交易代码 | 202009 |
| 后端交易代码 | 202010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年3月21日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,058,586,013.98份 |
| 投资目标 | 本基金为混合型基金,重点投资于具备持续良好盈利和分红能力、分红政策稳定的上市公司,以及高债息固定收益类投资品种。同时积极把握资本利得机会以拓展收益空间,力争为投资者谋求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。 |
| 投资策略 | 本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。 |
| 业绩比较基准 | 90%×上证红利指数+10%×上证国债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 南方基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

注:1、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"南方盛元";

2、本基金合同生效后一年内为封闭式,基金合同生效满一年后转为开放式,本基金已于2009年3月23日转为开放式。

3、本基金已于2015年8月8日转为混合型基金。

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -367,780,049.68 |
| 2.本期利润 | -616,488,026.63 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.5534 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,176,565,126.65 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.111 |

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收益;

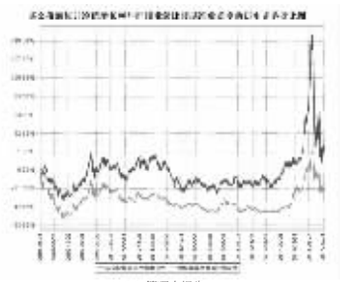
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -32.60% | 4.66% | -27.60% | 3.23% | -5.00% | 1.43% |

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变动的比较



§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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张旭 | 本基金基金经理 | 2012年11月23日 | - | 7年 | 毕