

## Disclosure

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  
报告期截止日：2008年10月22日

**§1 重要提示**

基金管理人的董事会及董事声明本基金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的规定，于2008年10月20日核对了本报告中的数据，确认其真实、准确和完整。除基金合同规定外，基金管理人和基金托管人对本基金合同规定的投资组合比例、净值表现、净资产值和投资组合报告等不承担复核责任。

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。投资人投资有风险，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。

本报告中所引用的资料未经审计。

本报告日期至2008年7月1日起至9月30日止。

**§2 基金产品概况**

基金简称 南方盛元

前一期收费代码 200409 后一期收费代码 201010

基金运作方式 灵利型，本基金合同生效一年内为封闭式，基金合同期满一年后转为开放式

基金合同生效日 2008年03月21日

报告期末基金份额总额 6,217,055,191.00份

投资目标 本基金为股票基金，主要投资于具备持续良好盈利能力、分红政策稳健的上市公司，以及具有较高收益回报品种。同时择机把资金投向可能以折价出售空头，力争为投资者超越市场的回报并长期稳定的增值。

投资策略 本基金将运用定量分析方法，对证券市场中的行业特征、风格特征、个股特征、区域特征、估值特征等进行综合分析，对证券市场的整体风险、基金资产的配置比例、调整比例和调整周期，定期或不定期地调整，以达到规避风险提高收益的目的。

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 本基金为股票基金，属于高风险、高收益的投资品种，其风险和收益水平高于股票型基金、债券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. 主要财务指标

报告期 2008年07月01日-2008年09月30日

1.本期已实现收益 -328,892,675.39

2.本期利润 -571,278,156.22

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0919

4.期末基金资产净值 4,858,900,665.62

5.期末基金份额净值 0.762

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. 所述基金绩效指标不包括持有人认购或交易基金的各费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.1 本基金报告期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③ 业绩比较基准收益率④ 业绩比较基准收益率标准差⑤

过去三个月 -10.42% 1.56% -13.93% 2.07% 3.51% -1.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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占0-40%，货币市场基金0-20%，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例最低可以为0；封闭期满转换为开放式基金后，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占0-35%，现金0-3%，货币市场基金占净资产的5%。

5.5 报告期末按债券种类的分类的债券投资组合

5.6 报告期末基金资产净值

5.7 投资组合报告

5.8 管理人报告

4.1 基金经理（基金经理小组）简介

姓名 职务 任期日期 离任日期 说明

汪激 基金基金经理 2008年4月 - 9年 CFA，工商管理硕士，1999年加入南方基金，先后担任研究员、魏军基金管理部，2002年4月-2006年5月任南方基金固定收益部总监，2006年5月-2008年4月任南方基金固定收益部总监。

5.9 报告期内本基金运作遵循诚信守信原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.10 报告期内本基金运作情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.11 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.12 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.13 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.14 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.15 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.16 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.17 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.18 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.19 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.20 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.21 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.22 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.23 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.24 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.25 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.26 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.27 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.28 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.29 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.30 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.31 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.32 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.33 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.34 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.35 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.36 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.37 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.38 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.39 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.40 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.41 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.42 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.43 报告期内本基金运作遵循公平交易原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.44 报告期内本基金运作遵循防范利益输送原则的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.45 报告期内本基金运作遵循集中度限制的情况说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂行办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法律、法规的规定，履行信息披露义务，没有损害基金份额持有人和其他利益相关者的合法权益。

5.46 报告期内本基金运作遵循关联交易的原则

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理暂