

南方全球精选配置证券投资基金 2009 年半年度报告摘要

2009年6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
基金合同生效日期:2009年08月25日

1.1 重要提示
本基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人南方基金和中国工商银行股份有限公司已于2009年08月21日签订了《本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资报告等内容的保证、担保及赔偿责任承诺书》,并承诺承担相应法律责任。

1.2 基金基本情况
基金名称:南方全球精选配置(QDII-FOF)
基金代码:202801
基金运作方式:契约型开放式

2.1 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:MSCI World Index*40%+MSCI 新兴市场指数*60%

2.2 基金投资组合报告
截至2009年06月30日,本基金资产组合情况如下:
资产总计:15,969,813,110.30
权益投资:4,882,952,503.55
其中:普通股:4,882,952,503.55

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人
境外投资顾问:BNY Mellon Asset Management International Limited
境外资产托管人:The Bank of New York Mellon

2.5 基金业绩评价
本基金业绩评价采用第三方独立机构网站,http://www.afund.com
基金半年度报告置备地点:基金管理人、基金托管人的办公地址

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
本期已实现收益:-32,246,672.76
本期公允价值变动收益:2,642,697,750.84

3.2 基金净值表现
3.2.1 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 基金份额净值增长率 业绩比较基准收益率 ①-③ ②-④

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比较
本基金自2009年8月25日成立以来,基金累计净值增长率为15.70%,同期业绩比较基准收益率为14.85%。

3.3 基金管理人及基金托管人
3.3.1 基金管理人及基金托管人
3.3.2 基金管理人及基金托管人

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人
4.1.2 基金管理人及基金托管人

4.2 基金管理人及基金托管人
4.2.1 基金管理人及基金托管人
4.2.2 基金管理人及基金托管人

4.3 基金管理人及基金托管人
4.3.1 基金管理人及基金托管人
4.3.2 基金管理人及基金托管人

4.4 基金管理人及基金托管人
4.4.1 基金管理人及基金托管人
4.4.2 基金管理人及基金托管人

4.5 基金管理人及基金托管人
4.5.1 基金管理人及基金托管人
4.5.2 基金管理人及基金托管人

4.6 基金管理人及基金托管人
4.6.1 基金管理人及基金托管人
4.6.2 基金管理人及基金托管人

4.7 基金管理人及基金托管人
4.7.1 基金管理人及基金托管人
4.7.2 基金管理人及基金托管人

4.8 基金管理人及基金托管人
4.8.1 基金管理人及基金托管人
4.8.2 基金管理人及基金托管人

4.9 基金管理人及基金托管人
4.9.1 基金管理人及基金托管人
4.9.2 基金管理人及基金托管人

相关制度,负责估值工作决策和执行的机构或人员中不包括基金经理。
4.8 基金管理人及基金托管人
4.8.1 基金管理人及基金托管人
4.8.2 基金管理人及基金托管人

4.9 基金管理人及基金托管人
4.9.1 基金管理人及基金托管人
4.9.2 基金管理人及基金托管人

4.10 基金管理人及基金托管人
4.10.1 基金管理人及基金托管人
4.10.2 基金管理人及基金托管人

4.11 基金管理人及基金托管人
4.11.1 基金管理人及基金托管人
4.11.2 基金管理人及基金托管人

4.12 基金管理人及基金托管人
4.12.1 基金管理人及基金托管人
4.12.2 基金管理人及基金托管人

4.13 基金管理人及基金托管人
4.13.1 基金管理人及基金托管人
4.13.2 基金管理人及基金托管人

4.14 基金管理人及基金托管人
4.14.1 基金管理人及基金托管人
4.14.2 基金管理人及基金托管人

4.15 基金管理人及基金托管人
4.15.1 基金管理人及基金托管人
4.15.2 基金管理人及基金托管人

4.16 基金管理人及基金托管人
4.16.1 基金管理人及基金托管人
4.16.2 基金管理人及基金托管人

4.17 基金管理人及基金托管人
4.17.1 基金管理人及基金托管人
4.17.2 基金管理人及基金托管人

4.18 基金管理人及基金托管人
4.18.1 基金管理人及基金托管人
4.18.2 基金管理人及基金托管人

4.19 基金管理人及基金托管人
4.19.1 基金管理人及基金托管人
4.19.2 基金管理人及基金托管人

4.20 基金管理人及基金托管人
4.20.1 基金管理人及基金托管人
4.20.2 基金管理人及基金托管人

4.21 基金管理人及基金托管人
4.21.1 基金管理人及基金托管人
4.21.2 基金管理人及基金托管人

4.22 基金管理人及基金托管人
4.22.1 基金管理人及基金托管人
4.22.2 基金管理人及基金托管人

4.23 基金管理人及基金托管人
4.23.1 基金管理人及基金托管人
4.23.2 基金管理人及基金托管人

4.24 基金管理人及基金托管人
4.24.1 基金管理人及基金托管人
4.24.2 基金管理人及基金托管人

4.25 基金管理人及基金托管人
4.25.1 基金管理人及基金托管人
4.25.2 基金管理人及基金托管人

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
单位:人民币元
关联方名称 2009年01月01日至2009年06月30日 2008年01月01日至2008年06月30日

6.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
6.4.5 期末2009年06月30日本基金持有的流通受限证券
6.4.5.1 期末2009年06月30日本基金持有的流通受限证券

6.4.5.2 期末未上市流通的限售股票
6.4.5.3 期末债券回购交易中作为抵押的债券
6.4.5.4 期末资产支持证券
7.1 期末基金资产组合情况

7.1.1 本基金期末投资组合的资产组合情况
7.1.2 本基金期末投资组合的行业分布情况
7.1.3 本基金期末投资组合的债券分布情况

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.3 期末按公允价值分类的股票投资组合
7.3.1 期末按公允价值分类的股票投资组合
7.3.2 期末按公允价值分类的股票投资组合

7.4 期末按公允价值分类的股票投资组合
7.4.1 期末按公允价值分类的股票投资组合
7.4.2 期末按公允价值分类的股票投资组合

7.5 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.5.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.6 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.6.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.7 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.7.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.8 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.8.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.9 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.9.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.10 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.10.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.11 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.11.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.12 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.12.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.13 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.13.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.14 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.14.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

7.15 基金对上市公司公允价值计量方法的说明
7.15.1 基金对上市公司公允价值计量方法的说明

5 SHARES NSCI TAIWAN INDEX FUND ETF基金 契约型开放式 Barclays Global Fund Advisors (巴克莱全球基金(国际)公司) 841,515,262.41 5.36

6 FINANCIAL SECTOR SPDR (金融行业投资基金) ETF基金 契约型开放式 iShares (爱迪生投资管理公司) 750,908,687.78 4.78

7 MARKET VECTORS FUND MANAGERS 基金 ETF基金 契约型开放式 Van Eck Associates Corp (范德克投资管理公司) 686,794,886.47 4.37

8 MARKET VECTORS FUND MANAGERS 基金 ETF基金 契约型开放式 Van Eck Associates Corp (范德克投资管理公司) 410,848,897.42 2.62

9 TECHNOLOGY SELECT SPDR (科技行业投资基金) ETF基金 契约型开放式 iShares (爱迪生投资管理公司) 276,412,791.73 1.76

10 ENERGY SELECT SPDR (能源行业投资基金) ETF基金 契约型开放式 iShares (爱迪生投资管理公司) 248,493,296.35 1.58

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券市值
7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.3.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.4 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.4.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.5 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.5.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.6 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.6.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.7.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.8 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.9 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.10 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.10.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.11 期末基金份额持有人户数及持有人结构
8.11.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构