

南方恒元保本混合型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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
报告送出日期:2010年10月26日

重要提示
基金管理人及董事承诺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2010年10月20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。

Table with 2 columns: 基金资产净值(元) and 基金份额总额. Rows include 基金资产净值, 基金份额总额, 基金份额净值, etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 600519 贵州茅台, 2. 000629 双汇发展, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 权证名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 038011 普华AGPI, 2. 038012 普华AGPI.

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款. Rows include 1. 存出保证金 1,358,558.52, 2. 应收证券清算款, etc.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,637,249,426.00, 2. 固定收益投资 1,117,334,011.59, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 600519 贵州茅台, 2. 000629 双汇发展, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 600519 贵州茅台, 2. 000629 双汇发展, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款. Rows include 1. 存出保证金 1,358,558.52, 2. 应收证券清算款, etc.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,637,249,426.00, 2. 固定收益投资 1,117,334,011.59, etc.

南方沪深300指数证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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
报告送出日期:2010年10月26日

重要提示
基金管理人及董事承诺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2010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。

Table with 2 columns: 基金资产净值(元) and 基金份额总额. Rows include 基金资产净值, 基金份额总额, 基金份额净值, etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 601318 中国平安, 2. 600036 招商银行, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 序号, 股票代码, 权证名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 038011 普华AGPI, 2. 038012 普华AGPI.

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款. Rows include 1. 存出保证金 1,358,558.52, 2. 应收证券清算款, etc.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,637,249,426.00, 2. 固定收益投资 1,117,334,011.59, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 600519 贵州茅台, 2. 000629 双汇发展, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 601318 中国平安, 2. 600036 招商银行, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款. Rows include 1. 存出保证金 1,358,558.52, 2. 应收证券清算款, etc.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,637,249,426.00, 2. 固定收益投资 1,117,334,011.59, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

微小偏差,更好地反映标的指数的表现,保障基金份额持有人的利益.我们在与各方协商一致后,自2010年7月2日起,已将该基金的跟踪偏离度调整至不超过0.4%.
本基金的投资目标:本基金投资于沪深300指数成份股及其备选成份股,旨在通过被动复制标的指数的表现,实现与标的指数相一致的长期投资收益.

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,报告期内本基金相对于业绩基准的跟踪误差为0.017%,年化跟踪误差为0.271%,自本基金建仓以来截至报告期末跟踪误差为0.808%,较好的完成了基金合同中约定的跟踪误差率不超过4%的投资目标.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,778,361,564.61, 2. 固定收益投资, etc.

Table with 2 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A. 农林、牧、渔业, B. 采矿业, C. 制造业, etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 601318 中国平安, 2. 600036 招商银行, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款. Rows include 1. 存出保证金 1,358,558.52, 2. 应收证券清算款, etc.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,637,249,426.00, 2. 固定收益投资 1,117,334,011.59, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 600519 贵州茅台, 2. 000629 双汇发展, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 601318 中国平安, 2. 600036 招商银行, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款. Rows include 1. 存出保证金 1,358,558.52, 2. 应收证券清算款, etc.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,637,249,426.00, 2. 固定收益投资 1,117,334,011.59, etc.

南方积极配置证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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
报告送出日期:2010年10月26日

重要提示
基金管理人及董事承诺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2010年10月20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。

Table with 2 columns: 基金资产净值(元) and 基金份额总额. Rows include 基金资产净值, 基金份额总额, 基金份额净值, etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 600519 贵州茅台, 2. 000629 双汇发展, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款. Rows include 1. 存出保证金 1,358,558.52, 2. 应收证券清算款, etc.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,637,249,426.00, 2. 固定收益投资 1,117,334,011.59, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 600519 贵州茅台, 2. 000629 双汇发展, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

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:2010年10月26日

重要提示
基金管理人及董事承诺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2010年10月20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。

Table with 2 columns: 基金资产净值(元) and 基金份额总额. Rows include 基金资产净值, 基金份额总额, 基金份额净值, etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

Table with 4 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

Table with 2 columns: 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(%). Rows include 1. 601318 中国平安, 2. 600036 招商银行, etc.

Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1. 国债券, 2. 央行票据, etc.

Table with 2 columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 基金经理 李蔚, 基金经理 李蔚.

Table with 2 columns: 序号, 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款. Rows include 1. 存出保证金 1,358,558.52, 2. 应收证券清算款, etc.

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1. 权益投资 1,637,249,426.00, 2. 固定收益投资 1,117,334,011.59, etc.