

南方优选成长混合型证券投资基金 2011 第一季度报告

2011年3月31日

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

重要提示:基金管理人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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金资产不受损失。

基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。 本报告自2011年01月30日起至2011年3月31日止。

§1 基金产品概况 基金名称:南方优选成长混合 基金代码:20203 交易代码:20203

基金运作方式:契约开放式 基金合同生效日:2011年1月30日 截至期末基金份额总额:2,216,873,965.77份

投资目标:本基金通过优选成长性较强的股票进行主动投资,并通过动态资产配置,增加组合的超额收益,在有效控制市场风险的前提下,力争为投资者谋求长期稳定的资产增值。

投资策略:本基金基于宏观环境、政策因素、经济周期、行业景气度、公司盈利和估值等因素,进行资产配置,确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%。 风险收益特征:本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平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: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“南方成长”。

§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元 主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 -10,907,496.51 2.本期利润 -35,117,496.09 3.加权平均基金份额本期利润 -0.0158

4.期末基金资产净值 2,181,756,469.68 5.期末基金份额净值 0.984 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.本基金的基金合同于2011年01月30日生效,故本报告期不足一季度。

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

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

第二季度在流动性依然充裕的背景下,市场仍有震荡向上的可能,本基金将密切跟踪市场动态,审慎操作,为持有人创造稳定的收益。

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0.984元,本报告期份额净值增长率为-1.60%,同期业绩比较基准收益率为3.22%。

§5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:1.以上表列债券外,本基金本报告期末持有其他债券。 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

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权证投资明细

5.8 投资组合报告附注 5.8.1 本基金报告期内,本基金本报告期没有发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。

5.8.2 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。 5.8.3 其他资产构成

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

天元证券投资基金 2011 第一季度报告

2011年3月31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

重要提示:基金管理人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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年04月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金资产不受损失。

基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。 本报告自2011年01月30日起至2011年3月31日止。

§2 基金产品概况 基金名称:天元 基金代码:186698 基金运作方式:契约封闭式

基金合同生效日:1999年8月25日 截至期末基金份额总额:3,000,000,000.00份

投资目标:本基金通过投资于国内证券市场,精选具有良好成长性的上市公司,进行长期投资,以稳健的投资策略,力求确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

投资策略:本基金通过深入研究,精选具有行业成长性、原质优、业绩优良、估值合理的股票,进行长期投资,以稳健的投资策略,力求确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。 风险收益特征:本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平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“天元基金”。

§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元 主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 53,872,415.45 2.本期利润 -69,284,794.41

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0228 4.期末基金资产净值 3,107,448,316.02

5.期末基金份额净值 1.0388 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。 3.2.1 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

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

§4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及各项实施准则,恪尽职守,勤勉尽责,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况 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,通过系统控制等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。 4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.3.4 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。 4.3.5 异常交易行为的专项说明

4.3.6 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。 4.3.7 异常交易行为的专项说明

4.3.8 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。 4.3.9 异常交易行为的专项说明

4.3.10 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。 4.3.11 异常交易行为的专项说明

4.3.12 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。 4.3.13 异常交易行为的专项说明

4.3.14 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。 4.3.15 异常交易行为的专项说明

4.3.16 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。 4.3.17 异常交易行为的专项说明

4.3.18 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。 4.3.19 异常交易行为的专项说明

4.3.20 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。 4.3.21 异常交易行为的专项说明

4.3.22 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。 4.3.23 异常交易行为的专项说明

4.3.24 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。 4.3.25 异常交易行为的专项说明

4.3.26 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。 4.3.27 异常交易行为的专项说明

4.3.28 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。 4.3.29 异常交易行为的专项说明

4.3.30 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。 4.3.31 异常交易行为的专项说明

4.3.32 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。 4.3.33 异常交易行为的专项说明

4.3.34 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。 4.3.35 异常交易行为的专项说明

4.3.36 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。 4.3.37 异常交易行为的专项说明

4.3.38 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。 4.3.39 异常交易行为的专项说明

4.3.40 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。 4.3.41 异常交易行为的专项说明

4.3.42 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。 4.3.43 异常交易行为的专项说明

4.3.44 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。 4.3.45 异常交易行为的专项说明

4.3.46 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。 4.3.47 异常交易行为的专项说明

4.3.48 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。 4.3.49 异常交易行为的专项说明

4.3.50 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。 4.3.51 异常交易行为的专项说明

4.3.52 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。 4.3.53 异常交易行为的专项说明

4.3.54 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。 4.3.55 异常交易行为的专项说明

4.3.56 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。 4.3.57 异常交易行为的专项说明

4.3.58 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。 4.3.59 异常交易行为的专项说明

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

重要提示:基金管理人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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金资产不受损失。

基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。 本报告自2011年01月30日起至2011年3月31日止。

§1 基金产品概况 基金名称:南方中证500指数证券投资基金(LOF) 基金代码:160119 交易代码:160119

基金运作方式:契约开放式 基金合同生效日:2009年9月25日 截至期末基金份额总额:3,223,384,765.97份

投资目标:本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律和数量化的风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪。

投资策略:本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律和数量化的风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪。

业绩比较基准:中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。 风险收益特征:本基金为被动式指数基金,其预期风险和收益水平与标的指数相似,且略高于标的指数。

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: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500”。

§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元 主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 68,856,336.95 2.本期利润 50,426,544.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0162 4.期末基金资产净值 4,008,257,030.28

5.期末基金份额净值 1.2435 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。 3.2.1 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

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

南方中证500指数证券投资基金(LOF) 2011 第一季度报告

2011年3月31日

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

重要提示:基金管理人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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金资产不受损失。

基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。 本报告自2011年01月30日起至2011年3月31日止。

§1 基金产品概况 基金名称:南方中证500指数证券投资基金(LOF) 基金代码:160119 交易代码:160119

基金运作方式:契约开放式 基金合同生效日:2009年9月25日 截至期末基金份额总额:3,223,384,765.97份

投资目标:本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律和数量化的风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪。

投资策略:本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律和数量化的风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪。

业绩比较基准:中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。 风险收益特征:本基金为被动式指数基金,其预期风险和收益水平与标的指数相似,且略高于标的指数。

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: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500”。

§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元 主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 68,856,336.95 2.本期利润 50,426,544.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0162 4.期末基金资产净值 4,008,257,030.28

5.期末基金份额净值 1.2435 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。

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

重要提示:基金管理人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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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,也不保证基金资产不受损失。

基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。 本报告自2011年01月30日起至2011年3月31日止。

§1 基金产品概况 基金名称:天元 基金代码:186698 基金运作方式:契约封闭式

基金合同生效日:1999年8月25日 截至期末基金份额总额:3,000,000,000.00份

投资目标:本基金通过投资于国内证券市场,精选具有良好成长性的上市公司,进行长期投资,以稳健的投资策略,力求确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

投资策略:本基金通过深入研究,精选具有行业成长性、原质优、业绩优良、估值合理的股票,进行长期投资,以稳健的投资策略,力求确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。 风险收益特征:本基金为混合型基金,其预期风险和收益水平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“天元基金”。

§3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币元 主要财务指标 报告期(2011年1月1日至2011年3月31日)

1.本期已实现收益 53,872,415.45 2.本期利润 -69,284,794.41

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0228 4.期末基金资产净值 3,107,448,316.02

5.期末基金份额净值 1.0388 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。 3.2.1 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

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

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

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