

南方多利增强债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12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
报告送出日期:2013年1月21日

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。

基金管理人南方多利增强债券型证券投资基金根据基金合同规定,于2013年1月16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。

本报告自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

基金产品概况
基金简称:南方多利增强债券
基金代码:202102

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年11月16日

报告期末基金份额总额:1,774,988,937.82份
本基金属于债券型基金,投资目标是:在债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场申购等投资手段和积极投资获取高于投资基准的收益。

投资目标:本基金属于债券型基金,投资目标是:在债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场申购等投资手段和积极投资获取高于投资基准的收益。

投资策略:首先我们根据宏观经济分析、资金流动分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期和债券品种结构;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等因素影响确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用定价技术,进行个券选择,选择被低估的品种进行投资,在具体投资操作中,我们采用骑乘操作、放大操作、息差操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。

风险收益特征:本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,预期收益高于货币市场基金,风险低于混合型基金。

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

报告期末基金份额总额:1,774,988,937.82份
报告期末基金份额总额:1,774,988,937.82份

注:1.本基金原南方多利中期债券型证券投资基金于2007年8月28日转型而来。
2.本基金在交易所行情系统净值估值等与基金信息披露平台不同,可理解为“南方多利”。

主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元
报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益:3,292,117.01
2.本期利润:13,869,416.97
3.加权平均基金份额本期利润:0.0172

4.期末基金份额净值:1,028,556,396.14
5.期末基金净值:1,065.6

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,本期利润为本本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2.本基金净值增长率扣除费用影响,即在扣除基金管理费、托管费、销售服务费后的净值增长率。
3.本基金净值增长率扣除费用影响,即在扣除基金管理费、托管费、销售服务费后的净值增长率。

3.2.2 本基金净值增长率扣除费用影响,即在扣除基金管理费、托管费、销售服务费后的净值增长率。

南方积极配置证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12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
报告送出日期:2013年1月21日

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。

基金管理人南方积极配置证券投资基金根据基金合同规定,于2013年1月16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。

本报告自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

基金产品概况
基金简称:南方积极配置(LOF)
基金代码:160105

基金运作方式:上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日:2004年10月14日

报告期末基金份额总额:1,948,233,923.82份
本基金为股票型基金,通过积极投资进行资产配置和行业配置,在时机选择的前提下,力争在控制风险并保持良好流动性的前提下,为投资者带来超越投资基准的收益。

投资目标:本基金为股票型基金,通过积极投资进行资产配置和行业配置,在时机选择的前提下,力争在控制风险并保持良好流动性的前提下,为投资者带来超越投资基准的收益。

投资策略:本基金为股票型基金,通过积极投资进行资产配置和行业配置,在时机选择的前提下,力争在控制风险并保持良好流动性的前提下,为投资者带来超越投资基准的收益。

风险收益特征:本基金为股票型基金,属证券投资基金中的高风险品种,预期收益高于混合型基金,风险高于债券型基金。

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

报告期末基金份额总额:1,948,233,923.82份
报告期末基金份额总额:1,948,233,923.82份

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,本期利润为本本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2.本基金净值增长率扣除费用影响,即在扣除基金管理费、托管费、销售服务费后的净值增长率。
3.本基金净值增长率扣除费用影响,即在扣除基金管理费、托管费、销售服务费后的净值增长率。

3.2.2 本基金净值增长率扣除费用影响,即在扣除基金管理费、托管费、销售服务费后的净值增长率。

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,992,031,346.21 85.41
其中:股票 1,992,031,346.21 85.41

2 固定收益投资 55,730,000.00 2.99
其中:债券 55,730,000.00 2.99

3 金融衍生品投资 -- --
其中:买入返售金融资产 -- --

4 买入返售金融资产 -- --
其中:买入返售金融资产 -- --

5 银行存款和结算备付金合计 213,863,690.08 11.47

6 其他资产 2,367,656.00 0.13

7 合计 1,863,992,693.19 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林牧渔 -- --
B 采掘业 5,235,869.10 0.28

C 制造业 32,757,557.00 1.78
其中:食品饮料 652,354,013.39 35.48

CD 医药、生物制品 195,589,498.80 10.64

C1 纺织服装、皮毛 34,663,056.96 1.89

C2 木材、家具 3,603,000.00 0.20

C3 造纸、印刷 -- --

C4 石油、化学、塑胶、塑料 109,332,944.75 5.95

C5 电子 38,126,334.47 2.07

C6 金属、非金属 20,218,755.57 1.10

C7 机械、设备、仪表 136,630,711.22 7.43

C8 医药、生物制品 114,189,718.64 6.21

C9 其他 -- --

D 电力、煤气及水的生产和供应业 29,331,477.48 1.60

E 建筑业 160,374,182.00 8.72

F 交通运输、仓储业 -- --

G 信息技术业 47,992,000.00 2.61

H 批发和零售贸易 111,583,434.56 6.07

I 金融、保险业 325,605,650.00 17.68

J 房地产业 179,794,807.18 9.78

K 社会服务业 47,552,400.00 2.59

L 综合类 -- --

M 合计 1,992,031,346.21 85.58

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 600519 贵州茅台 427,583 89,373,398.66 4.86

2 000002 万科A 8,000,000 84,960,000.00 4.62

3 600000 浦发银行 7,124,437 70,674,415.04 3.84

4 000051 格力电器 2,500,000 63,750,000.00 3.47

5 600133 建设股份 8,017,878 56,365,682.34 3.07

6 601668 中国建筑 14,200,900 55,295,210.00 3.01

7 601601 中国太保 2,277,669 51,247,552.50 2.79

8 002037 久谦资管 2,079,039 51,040,407.45 2.78

9 600030 中信证券 3,416,310 45,641,400.00 2.48

10 600036 招商银行 3,312,180 45,542,475.60 2.48

5.4 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债券投资明细
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(%)

1 110901 国债09 -- --

2 央行票据 -- --

3 金融债 -- --
其中:政策性金融债 -- --

4 企业债 55,730,000.00 3.03

5 企业短期融资券 -- --

6 中期票据 -- --

7 可转债 -- --

8 其他 -- --

9 合计 55,730,000.00 3.03

5.5 报告期末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
序号 股票代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 112051 11国债02 200,000 20,860,000.00 1.13

2 122114 11国债 -- 200,000 20,030,000.00 1.09

3 122118 12国债01 100,000 10,000,000.00 0.55

4 120044 08国债 -- 50,000 4,740,000.00 0.26

5.6 报告期末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品种
本基金本报告期末持有资产支持证券

5.7 报告期末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
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资的前十名证券中,没有投资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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 3,140,539.8