

## 天元证券投资基金

### 2013 第一季度 报告

2013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  
报告送出日期:2013年4月19日

#### 1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者有风险,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。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告自2013年1月1日起至2013年3月31日止。

#### 1.2 基金产品概况

基金简称	天元开放式
交易代码	184608
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	1999年8月25日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
投资目标	本基金属于成长型股票基金,主要投资于两个市场中的优质标的,本基金所投资股票是符合行业代表、成长性、资本增值潜力、分红稳定性和公司治理等标准中挑选出的优质上市公司,本基金的投资目标是追求在合理控制风险的前提下,以稳健的投资策略,确保基金资产安全并追求基金长期稳定的增值。
投资策略	根据研究报告,本基金通过深入的研究,选取具有行业代表性、股票增值性强、资本增值潜力大、分红稳定等特点的优质上市公司,进行中长期投资,以稳健的投资策略,力求确保基金资产安全并追求基金长期稳定的增值。
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显示净值偏离度其他信息披露场合下,可称为“天元基金”。

#### 1.3 主要财务指标和基金净值表现

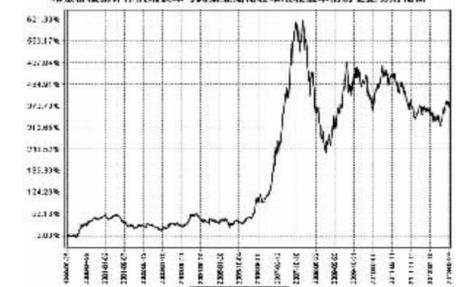
主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	6371384.71	
2.本期利润	77,172,880.41	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0257	
4.期末基金资产净值	2,656,109,921.13	
5.期末基金份额净值	0.8854	

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.上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 本基金净值增长率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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.00%	2.13%	-	-	-3.00%	2.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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的比较



注:本基金建仓期为三个月,建仓期结束时各项资产配置符合基金合同约定。

#### 1.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
葛明晖	本基金的基金经理	2010年12月21日	-	8	硕士研究生学历,美国哥伦比亚大学金融学硕士学位,具有基金从业资格,曾任南方基金子公司基金管理部分析师,2005年加入南方基金,2008年4月至2010年12月,任南方基金基金经理,2008年4月至今,任南方基金基金经理,2009年2月至2012年12月,任南方基金基金经理,2010年12月至今,任天元基金基金经理。
陈捷	本基金的基金经理	2006年3月16日	-	12	硕士学位,具有基金从业资格,2000年加入南方基金,历任行业研究员、基金经理助理,2005年12月至今,担任投资经理职务,主持工作,2003年11月-2005年6月,任南方基金基金经理,2004年3月-2005年3月,任南方基金基金经理,2005年3月-2006年3月,任南方基金基金经理,2008年3月,任南方基金基金经理,2008年3月至2009年3月,任天元基金基金经理,2009年3月至今,任天元基金基金经理,2010年10月至今,任南方基金基金经理,2012年12月至今,任天元基金基金经理。

4.2 管理人及报告期内基金管理人遵守法律法规的情况

4.3 公平交易专项说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作情况说明

4.5 报告期内基金业绩表现说明

4.6 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况	序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
	1	权益投资	1,729,493,201.37	64.90
	2	固定收益投资	593,140,324.00	22.26
	3	金融资产投资	2,322,633,525.37	87.16
	4	买入返售金融资产	-	-
	5	银行存款和结算备付金合计	320,208,000.88	12.02
	6	其他资产	21,967,424.44	0.82
	7	合计	2,664,808,925.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	105,148,699.86	3.96
C	制造业	690,451,400.90	25.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	140,424,411.26	5.29
E	建筑业	139,978,315.34	5.27
F	批发和零售业	96,198,715.38	3.62
G	交通运输、仓储和邮政业	11,632,921.70	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	24,891,786.40	0.94
J	金融业	308,613,082.29	11.62
K	房地产业	154,276,494.24	5.81
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,013,735.82	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	28,703,644.50	1.08
S	综合	8,159,959.68	0.31
	合计	1,729,493,201.37	65.11

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	002570	贝因美	3,370,436	13,154,412.72	4.95
2	601166	兴银证券	5,504,637	95,230,220.10	3.59
3	600795	国电电力	22,769,000	67,623,930.00	2.55
4	600594	浙富控股	2,131,892	62,997,468.60	2.37
5	600000	浦发银行	5,999,970	60,779,696.10	2.29
6	600240	华业地产	12,629,524	58,979,877.40	2.22
7	002007	华兰生物	2,370,084	57,924,852.96	2.18
8	601668	中国建筑	17,003,784	57,302,752.08	2.16
9	600036	招商银行	4,503,333	56,877,095.79	2.14
10	600511	国药股份	2,955,116	53,162,536.84	2.00

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五名债券投资明细

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	1001074	10国债74	2,000,000	199,800,000.00	7.52
2	1001060	10国债60	1,500,000	149,895,000.00	5.64
3	120314	12进出14	500,000	50,005,000.00	1.88
4	120245	12国债45	500,000	49,975,000.00	1.88
5	120228	12国债28	500,000	49,955,000.00	1.88

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资产投资明细

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	1001074	10国债74	2,000,000	199,800,000.00	7.52
2	1001060	10国债60	1,500,000	149,895,000.00	5.64
3	120314	12进出14	500,000	50,005,000.00	1.88
4	120245	12国债45	500,000	49,975,000.00	1.88
5	120228	12国债28	500,000	49,955,000.00	1.88

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 报告期末本基金投资组合中存在资产支持证券的情况

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金本报告期末前十名证券中不存在发行主体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、处罚的证券。

5.9.2 本基金本报告期末前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定股票品种之外的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	结算备付金	639,891.31
2	应收证券清算款	11,282,930.93
3	应收利息	-
4	应收股利	10,088,541.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,967,424.44

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	118003	债转股03	2,655,324.00	0.10

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况说明

5.9.6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期末前十名持有人的封闭式基金份额	44,335,529.00
报告期末前十名持有人的开放式基金份额	44,335,529.00
报告期末前十名持有人的基金份额合计	44,335,529.00

5.9.7 备查文件目录

- 《天元证券投资基金合同》;
- 《天元证券投资基金托管协议》;
- 《天元证券投资基金2013年第一季度报告原文》;

5.9.8 存放地点

5.9.9 查阅方式

5.9.10 网站: http://www.nffund.com

5.9.11 报告期末基金资产组合情况

基金简称	南方安心保本混合
交易代码	202213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月21日
报告期末基金份额总额	2,310,675,460.34份
投资目标	本基金在追求保本的前提下,通过大类资产配置,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金按照合同约定投资于低风险资产,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:三年期定期存款税后收益率+0.5%。
风险收益特征	本基金为保本型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
基金投资	招商银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情显示净值偏离度其他信息披露场合下,可称为“南方安心保本混合”。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	10,332,352.22	
2.本期利润	4,248,489.96	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018	
4.期末基金资产净值	2,397,794,711.12	
5.期末基金份额净值	1.005	

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损益。

2.本基金净值增长率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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.29%	0.08%	1.17%	0.02%	-0.97%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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的比较



注:本基金合同生效至本报告期末不满一年,本基金建仓期为自基金合同生效日起6个月,至本报告期末,建仓期未结束。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	10,332,352.22	
2.本期利润	4,248,489.96	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018	
4.期末基金资产净值	2,397,794,711.12	
5.期末基金份额净值	1.005	

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损益。

2.本基金净值增长率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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.29%	0.08%	1.17%	0.02%	-0.97%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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的比较



注:本基金合同生效至本报告期末不满一年,本基金建仓期为自基金合同生效日起6个月,至本报告期末,建仓期未结束。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	10,332,352.22	
2.本期利润	4,248,489.96	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018	
4.期末基金资产净值	2,397,794,711.12	
5.期末基金份额净值	1.005	

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损益。

2.本基金净值增长率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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.29%	0.08%	1.17%	0.02%	-0.97%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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的比较



注:本基金合同生效至本报告期末不满一年,本基金建仓期为自基金合同生效日起6个月,至本报告期末,建仓期未结束。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	10,332,352.22	
2.本期利润	4,248,489.96	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018	
4.期末基金资产净值	2,397,794,711.12	
5.期末基金份额净值	1.005	

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损益。

2.本基金净值增长率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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.29%	0.08%	1.17%	0.02%	-0.97%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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的比较



注:本基金合同生效至本报告期末不满一年,本基金建仓期为自基金合同生效日起6个月,至本报告期末,建仓期未结束。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	10,332,352.22	
2.本期利润	4,248,489.96	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018	
4.期末基金资产净值	2,397,794,711.12	
5.期末基金份额净值	1.005	