南方绩优成长股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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2013年10月21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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方绩优成长股票
交易代码	202003
前端交易代码	202003
后端交易代码	202004
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	6,168,294,258.22份
投资目标	本基金为股票型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,根据对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡与精选,力争为投资者寻求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。
投资策略	本基金的股票投资主要采用"自下而上"的策略,通过对上市公司基本面的深入研究,基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡,不仅重视公司的业绩与成长性,更注重公司的业绩与成长性的质量,精选中长期持续增长或未来阶段性高速增长、业绩质量优秀,且价值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金的股票投资同时结合"自上而下"的行业分析,根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业,以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。 本基金将优先选择具有良好的行业增长空间,所处行业结构相对稳定,在产业链中处于优势地位或上下游运行态势好转,具有一定的垄断竞争优势,公司治理结构透明完善,管理水平领先的上市公司。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	预期风险收益水平高于混合型基金、债券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"南方绩优"

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)
1.本期已实现收益	155,614,377.96
2.本期利润	912,132,333.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.1440
4.期末基金资产净值	8,272,358,535.72
5.期末基金份额净值	1.3411

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。

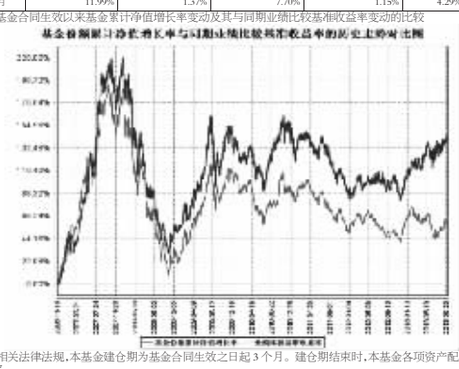
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

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	11.99%	1.37%	7.70%	1.15%	4.29%	0.22%

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的比较



注:根据相关法律法规,本基金建仓期为基金合同生效之日起3个月。建仓期结束时,本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

§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
		任职日期	离任日期		
张原	本基金的基金经理	2010年2月12日	-	7	美国密歇根大学经济学硕士学位,具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金,曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员,南方高增及南方隆元基金经理助理,2009年9月至2013年4月,任南方500基金经理;2010年2月至今,任南方绩优基金经理;2011年2月至今,任南方高增基金经理。
史博	本基金的基金经理,公司研究部总监	2011年2月17日	-	15	特许金融分析师(CFA),硕士学历,13年研究及投资管理经验,具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004年7月-2005年2月,任泰达周期基金经理;2007年7月-2009年5月任泰达首选基金经理;2008年8月-2009年9月任泰达市值基金经理;2009年4月-2009年9月任泰达品质基金经理。2009年10月加入南方基金,现任南方基金研究部总监、投资决策委员会委员。2011年2月至今,任南方绩优基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施细则、《南方绩优成长股票型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,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,通过系统和人工等各种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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次,是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度,在上一季度主要经济指标连续低于预期的基础上,三季度的发电量、工业增加值等指标出现环比回暖,显示经济有改善的迹象,二季度末的流动性紧张也大幅缓解,市场信心扭转向上,股指触底反弹。行业表现上,蓝筹股率先触底,但市场增量资金不足导致随后回落,近期市场的热点围绕着政策展开,从前期的上海自贸区,到土地流转,从银行试点优先股,到军工重组板块,各主题热点各放异彩,行业板块间持续分化。

三季度的具体操作上,我们在仓位和持仓结构上较好地主重了控制,继续优化行业配置及个股组合,保持电子计算机等成长行业的高配置,一定程度增强对互联网类公司的配置,并继续自下而上关注盈利增长稳定和业绩超预期的公司。总体上还操作时本基金绩效带来正面效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年三季度,南方绩优成长基金净值增长11.99%,同期业绩比较基准增长7.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,外围环境上,美联储那伦获提名将延缓市场对美国退出量化宽松政策时间和节奏的预期。国内已公布的宏观经济运行数据显示生产在不断恢复,三季度的宏观数据和企业三季报的盈利增速有一定的确定性。但四季度受去年同期基数相对较高影响,宏观数据较难持续超预期,且伴随三中全会各项改革发展举措出台、群众路线教育实践活动深入、IPO重启等重大不确定性政治及经济事件的发生,实体经济和市场情绪都将经历预期的产生、证实或证伪、不断修正等阶段,市场的复杂性仍然较高。

我们对四季度的市场表现持谨慎的态度。宏观上的不温不火,渐进改革可能使得市场指数保持震荡整理,符合政策方向的行业仍有战胜指数的机会,但考虑到前三季度结构化分化比较严重,一些板块过度透支了预期,在四季度可能出现行业收益率和指数收益率背离的情况。

基于以上判断,在四季度我们会继续努力,勤勉尽责,并在此基础上优选板块及个股的投资机会,努力为持有人创造超额收益。

§5 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	7,194,072,763.86	86.58
	其中:股票	7,194,072,763.86	86.58
2	固定收益投资	359,452,000.00	4.33
	其中:债券	359,452,000.00	4.33
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	726,898,756.30	8.75
6	其他资产	28,949,073.30	0.35
7	合计	8,309,372,593.46	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	-	-
C	制造业	3,699,682,956.71	44.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,840,000.00	0.41
E	建筑业	356,547,087.24	4.31
F	批发和零售业	431,155,458.90	5.21
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,022,583,868.84	12.36
J	金融业	791,418,565.22	9.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,355,513.68	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	488,400,000.00	5.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,854,384.36	0.30
R	文化、体育和娱乐业	192,518,738.99	2.33
S	综合	125,716,189.92	1.52
	合计	7,194,072,763.86	86.97

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	002236	大华股份	15,300,000	650,154,000.00	7.86
2	002415	海康威视	22,044,482	581,974,324.80	7.04
3	300070	碧水源	12,000,000	488,400,000.00	5.90
4	002024	苏宁云商	33,552,954	431,155,458.90	5.21
5	601166	兴业银行	32,630,586	364,483,645.62	4.41
6	601318	中国平安	9,825,628	350,774,919.60	4.24
7	000917	电广传媒	15,499,902	289,848,167.40	3.50
8	000977	浪潮信息	4,999,877	255,743,708.55	3.09
9	600887	伊利股份	5,499,847	245,733,163.96	2.97
10	002051	中工国际	10,186,898	231,372,122.14	2.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	359,452,000.00	4.35
	其中:政策性金融债	359,452,000.00	4.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	359,452,000.00	4.35

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	120245	12国开45	2,000,000	199,720,000.00	2.41
2	130201	13国开01	1,000,000	99,750,000.00	1.21
3	030224	03国开24	600,000	59,982,000.00	0.73

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,349,706.77
2	应收证券清算款	10,637,888.90
3	应收股利	2,309,217.90
4	应收利息	9,078,400.10
5	应收申购款	1,573,859.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,949,073.30

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002236	大华股份	226,260,000.00	2.74	非公开发行
2	002051	中工国际	138,772,122.14	1.68	非公开发行

注:本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	6,445,743,162.37
报告期期间基金总申购份额	46,960,162.44
减:报告期期间基金总赎回份额	324,409,066.59
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	6,168,294,258.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、南方绩优成长股票型证券投资基金基金合同。

2、南方绩优成长股票型证券投资基金托管协议。

3、南方绩优成长股票型证券投资基金2013年3季度报告原文。

8.2 存放地点

深圳市福田中心区福华1路6号免税商务大厦31至33楼

8.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方隆元产业主题股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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2013年10月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方隆元产业主题股票
交易代码	202007
前端交易代码	202007
后端交易代码	202008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年11月9日
报告期末基金份额总额	8,054,563,048.94份
投资目标	本基金为积极型股票基金,在准确把握产业发展趋势和市场运行态势的基础上,集中精选具备国民经济三大产业主题的优势行业和上市公司进行投资,有效控制投资组合风险,追求较高的超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在投资策略上采取"自上而下"积极进行资产配置、行业轮动配置和"自下而上"精选个股相结合的方法。在新一轮产业结构调整和产业升级中,发展先进制造业、提高现代服务业比重和加强基础产业基础设施建设,是国家产业结构调整的重要任务。因此,关于先进制造业、现代服务业和基础产业的投资主题固是本基金所指的三大"产业主题"。在上述三大产业的基础上,本基金采取"自上而下"的方式进行行业配置,即基于行业竞争优势和市场结构等进行基本面分析,结合行业的历史表现、收益预期、行业经济政策面等,进行综合的相对吸引度评分,然后在市场基准比例的基础上进行行业的轮动配置,选择符合国家产业发展政策,在国民经济三大产业中占据行业优势地位,超额收益率或预测超额收益率水平较高的行业做重点投资。
业绩比较基准	85%×沪深300指数+15%×上证国债指数
风险收益特征	预期风险收益水平高于混合型基金、债券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:1、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"南方隆元"。2、本基金自2007年11月09日由封闭式基金隆元证券投资基金转型而成。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-121,589,973.82
2.本期利润	618,531,786.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0740
4.期末基金资产净值	4,110,989,311.43
5.期末基金份额净值	0.510

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.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 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

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	16.70%	1.63%	8.15%	1.22%	8.55%	0.41%

注:本基金自2007年11月09日由封闭式基金隆元证券投资基金转型而成。

3.2.2 自基金转型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的比较

注:本基金自2007年11月09日由封闭式基金隆元证券投资基金转型而成。

§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
		任职日期	离任日期		
汪澈	本基金基金经理、公司投资部副总监	2008年4月11日	-	14	注册金融分析师(CFA),工商管理硕士,具有基金从业资格。1999年加入南方基金,先后担任研究员、基金经理助理,2002年4月-2006年3月,任隆元基金经理;2005年8月-2006年3月,任金元基金经理;2006年3月至今,任开元基金经理;2008年4月至今,任南方隆元基金经理。
蒋朋宸	本基金基金经理	2008年4月11日	-	9	北大生物化学硕士、美国哥伦比亚大学金融工程学硕士,具有基金从业资格。曾担任鹏华基金公司基金管理部分析师,2005年加入南方基金,2008年4月至今,任南方盛元基金经理;2008年4月至今,任南方隆元基金经理;2009年2月至今,任南方宝元债券基金经理。2010年12月至今,任基金天元基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方隆元产业主题股票型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,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,通过系统和人工等各种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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为三次,是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年三季度,中国经济进入了一个较低速但更均衡和更可持续的发展阶段。中央不出台短期刺激政策但致力于促进经济结构转型的施政方略给经济带来长期正面影响,这提升了市场对经济和股市的长期信心。近期中央领导人及国务院各部委多次表示,对中国经济的长期前景看好,对中国经济结构转型成功和经济均衡可持续发展的信心很足。国务院国资委也表示应该进一步提高央企对中国经济的贡献,要求央企继续保持正增长,这在经济转型期非常难能可贵,是央企蓝筹股具备长期投资价值的坚实基石。习主席的多次讲话显示,中国不断提高军事力量准备步伐和采取积极的国防防御政策是国家未来不可避免的大政方针之一,本基金认为军工股进入了长期价值投资区间。中央政治局集体学习海洋经济有关内容,要把海洋经济建设成为未来中国经济发展新的支柱产业。随着人民财富的不断积累,以及郭主席和肖主席的金融创新思路,财富管理行业将成为未来快速发展的重要产业。本基金在报告期内继续重点配置大型央企蓝筹股,将行业配置重点放在海洋经济、军工产业和财富管理相关行业上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年三季度,本基金的净值增长率为16.70%。

§5 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	3,709,202,380.94	89.95
	其中:股票	3,709,202,380.94	89.95
2	固定收益投资	169,096,200.00	4.10
	其中:债券	169,096,200.00	4.10
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	227,418,988.93	5.51
6	其他资产	18,058,636.75	0.44
7	合计	4,123,776,206.62	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	26,997,570.00	0.66
B	采矿业	717,350,915.02	17.45
C	制造业	1,575,762,400.93	38.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	348,840,293.88	8.49
G	交通运输、仓储和邮政业	109,637,920.80	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	789,253,280.31	19.20
K	房地产业	141,360,000.00	3.44
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,709,202,380.94	90.23

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	600739	辽宁成大	20,133,062	312,867,783.48	7.61
2	601989	中国重工	50,552,317	308,369,133.70	7.50
3	600837	海通证券	24,500,000	306,495,000.00	7.46
4	600030	中信证券	24,000,000	294,960,000.00	7.17
5	601808	中海油服	11,300,000	200,462,000.00	4.88
6	600150	中国船舶	10,605,000	195,450,150.00	4.75
7	600583	海油工程	26,064,093	192,874,288.20	4.69
8	600547	山东黄金	7,580,474	168,059,108.58	4.09
9	600489	中金黄金	15,979,049	155,955,518.24	3.79
10	600118	中国卫星	8,000,000	114,160,000.00	2.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	169,096,200.00	4.11
8	其他	-	-
9	合计	169,096,200.00	4.11

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	113003	重工转债	1,330,000	169,096,200.00	4.11

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	738,454.52
2	应收证券清算款	16,574,990.23
3	应收股利	-
4	应收利息	217,783.23
5	应收申购款	527,408.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,058,636.75

5.10.4 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	113003	重工转债	169,096,200.00	4.11

5.10.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	8,333,720,719.73
报告期期间基金总申购份额	691,616,040.95
减:报告期期间基金总赎回份额	970,773,711.74
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	8,054,563,048.94

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《南方隆元产业主题股票型证券投资基金基金合同》

2、《南方隆元产业主题股票型证券投资基金托管协议》

3、南方隆元产业主题股票型证券投资基金2013年3季度报告原文。

8.2 存放地点

深圳市福田中心区福华1路6号免税商务大厦31至33楼

8.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方全球精选配置证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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2013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。

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。

本报告以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方全球精选配置(QDII-FOF)
交易代码	202801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年9月19日
报告期末基金份额总额	15,376,525,278.01份
投资目标	通过基金全球化的资产配置和组合管理,实现组合资产的分散化投资,在降低组合波动性的同时,实现基金资产的最大增值。
投资策略	本基金在基金资产的配置上采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略,在有效分散风险的基础上,提高基金资产的收益。 1、战略性资产配置策略(Strategic Asset Allocation) 在宏观经济与地区经济分析,掌握全球经济趋势的基础上,通过量化分析,确定资产种类(Asset Class)与权重,并定期进行回顾和动态调整。 2、战术性资产配置策略(Tactical Asset Allocation) 在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置,在不同国家的配置比例上采用"全球资产配置量化"模型进行配置和调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动,基金经理将根据对不同因素的研究与判断,对基金投资组合进行调整,以降低投资组合的投资风险。本基金的大部分资产将投资于ETF基金、股票型基金和在香港市场投资于公开发行、上市的股票。利用定量和定性的方式筛选基金,在香港市场的选股策略的主要标准: 市场及行业地位(market position)、估值(intrinsic value)、盈利预期(earning surprise)、和良好的趋势(investment trend)。
业绩比较基准	60%×MSCI世界指数(MSCI World Index)+40%×MSCI新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index)。
风险收益特征	本基金为基金中基金,属于中等偏高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平低于全球股票型基金,高于债券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"南方全球"。

2.2 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Bank of New York Mellon
	中文	纽约梅隆银行有限公司
注册地址		One Wall Street New York, NY10286
办公地址		One Wall Street New York, NY10286
邮政编码		10286

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日—2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-188,846,598.60
2.本期利润	840,041,871.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0525
4.期末基金资产净值	11,131,607,622.67
5.期末基金份额净值	0.724

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。

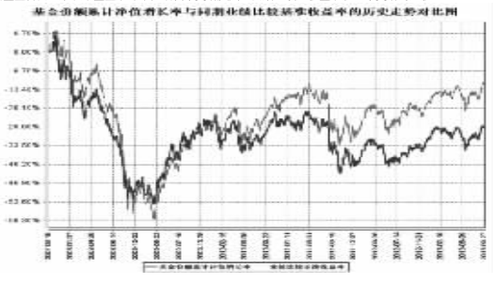
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

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	7.90%	0.72%	6.97%	0.63%	0.93%	0.09%

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的比较



注:本基金建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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
		任职日期	离任日期		
黄兆	本基金的基金经理	2009年6月25日	-	12	北京大学工商管理硕士,具有基金从业资格。曾任职于招商证券股