

南方恒元保本混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年7月19日

1.1 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2014年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表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构成其业绩表现,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。
本报告自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

1.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 南方恒元保本混合; 交易代码, 202211; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2010年11月13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; 基金经理, 李健; 基金业绩比较基准, 中证全债指数收益率; 风险收益特征, 本基金为保本混合基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

1.3 主要财务指标和基金净值表现

注:本基金在交易所行情系统净值估值等其他信息披露场合下,可简称为“南方恒元”。

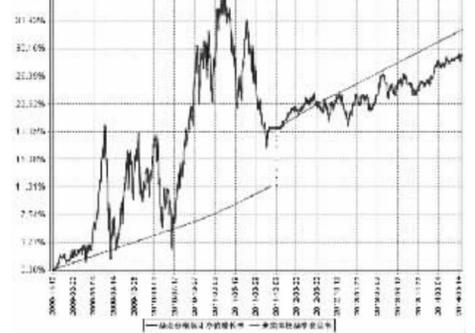
Table with 2 columns: 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日); 1.本期已实现收益, 27,305,541.21; 2.本期利润, 25,394,260.01; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.01032; 4.期末基金份额净值, 1.078,015,855.66; 5.期末基金净值增长率, 1.06%

注:1.本基金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.基金净值表现
3.1 本报告期末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

Table with 6 columns: 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, 净值增长率与业绩比较基准收益率的差额④-③, ①-③, ②-③

3.2 自基金合同生效以来基金业绩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

基金业绩累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图



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。本基金的一个保本周期为三年,自2008年11月23日至2011年11月14日止;第二个保本周期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日止。

1.4 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期; 李健, 基金经理, 2012年12月14日, -

注:1.对基金的聘任基金经理,“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期;对此外的非聘任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

1.5 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《证券投资基金管理人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,公平对待管理下的所有基金投资组合。
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0次,是由于指数型基金根据标的指数成份股被动调整所致。

1.6 投资组合报告

Table with 2 columns: 报告期末基金资产组合情况; 权益投资, 1,979,513,448.56; 固定收益投资, 114,441,962.92; 基金投资, 1,855,790,885.64

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%); 1. 权益投资, 181,887,264.59, 9.16; 2. 固定收益投资, 1,217,634,527.00, 66.80; 3. 基金投资, 1,271,634,527.00, 66.50

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); A 农林牧渔, 0.00; B 采矿业, 0.00; C 制造业, 1,855,790,885.64, 100.00

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 601006 大秦铁路, 97,010,607.83, 4.93; 2. 600574 信达地产, 5,678,025, 0.05

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 国债, 221,832,000.00, 11.21; 2. 央行票据, 221,832,000.00, 11.21; 3. 金融债, 221,832,000.00, 11.21

Table with 4 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(%); 1. 130241 13国债(4), 1,200,000, 0.06; 2. 140208 14国债(8), 100,760,000.00, 5.14

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600205 中国铝业, 464,008, 0.33; 2. 601555 华信国际, 823,200, 0.30; 3. 601170 中国电建, 1,502,409, 0.29

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 130241 13国债(4), 1,200,000, 0.06; 2. 140208 14国债(8), 100,760,000.00, 5.14; 3. 092111 09央行票据1, 100,830,000.00, 5.17

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

南方高增长证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年7月19日

1.1 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2014年7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构成其业绩表现,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。
本报告自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

1.2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 南方高增长混合(LOF); 交易代码, 160106; 基金运作方式, 上市契约型开放式(LOF); 基金合同生效日, 2005年7月13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; 基金经理, 李健; 基金业绩比较基准, 中证全债指数收益率; 风险收益特征, 本基金为股票基金,属于证券投资基金中的高风险品种。

注:本基金在交易所行情系统净值估值等其他信息披露场合下,可简称为“南方高增长”。

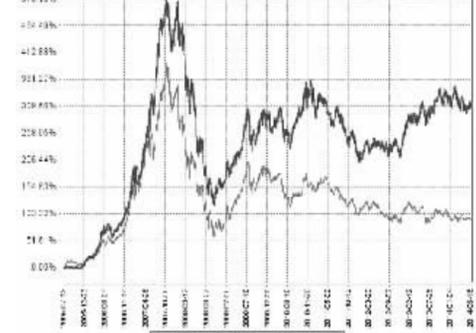
Table with 2 columns: 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日); 1.本期已实现收益, -24,307,708.41; 2.本期利润, 101,099,049.13; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0514; 4.期末基金份额净值, 2,709,900,464.50; 5.期末基金净值增长率, 1.862%

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
3.1 本报告期末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

Table with 6 columns: 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, 净值增长率与业绩比较基准收益率的差额④-③, ①-③, ②-③

3.2 自基金合同生效以来基金业绩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

基金业绩累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图



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。本基金的一个保本周期为三年,自2008年11月23日至2011年11月14日止;第二个保本周期为三年,自2011年12月13日至2014年12月13日止。

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期; 李健, 基金经理, 2012年12月17日, -

注:1.对基金的聘任基金经理,“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期;对此外的非聘任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

报告送出日期:2014年7月19日

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2014年7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构成其业绩表现,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。
本报告自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 600519 华研精业, 64,403, 0.46; 2. 600312 平安银行, 579,014, 8.08; 3. 300322 奥翔药业, 107,248, 0.35

Table with 4 columns: 序号, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%