

南方安心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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月9日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会及董事承诺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。基金托管人招商银行股份有限公司根据南方基金合法合规的运作,于2014年7月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者应自行承担投资风险。南方基金的投资决策程序符合法律法规及基金合同的约定。

本报告中所指投资业绩比较基准为南方安心保本混合型证券投资基金业绩比较基准。
本报告自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	南方安心保本混合
交易代码	202123
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	1,598,801,645.15份
投资目标	本基金在确保本金的前提下,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金按照利率平价理论构建组合,通过利率平价理论,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。本基金按照利率平价理论构建组合,通过利率平价理论,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:一年定期银行定期存款利率+0.5%。
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金,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
基金销售人	南方基金管理有限公司
基金注册登记人	南方基金管理有限公司

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,可称为“南方安心”。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,846,062.49
2.本期利润	62,561,165.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0372
4.期末基金份额净值	1.066,460,844.67
5.期末基金资产净值	1,055

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。

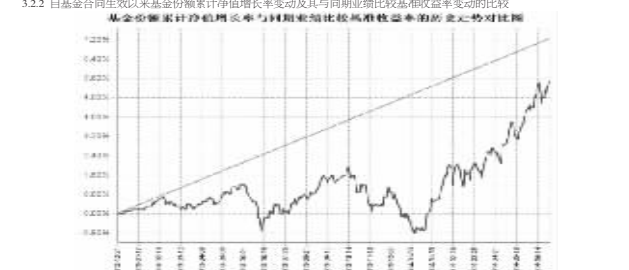
2.期末基金份额净值不包括持有人认购及申购基金的各项费用,计入费用后扣除赎回费水平低于所列数字。

3.1.2 基金业绩指标:
1. 本基金本报告期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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3	2-4
过去三个月	3.74%	0.20%	1.12%	0.01%	2.62%	0.19%

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的对比图



注:本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期间各资产类别资产配置符合合同约定。

4.1 基金经理

姓名
 任 | 任 | 任 || 姓名 | 任 | 任 | 任 |
| 姓名 | 任 | 任 | 任 |

注:1.对基金曾任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为基金合同生效日确定的解聘或到期后的首任基金经理“任职日期”和“离任日期”孰前的日期,如基金经理离职日期和到期日期不一致的,以离职日期为准。

2.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

3.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

4.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

5.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

6.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

7.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

8.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

9.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

10.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

11.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

12.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

13.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

14.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

15.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

16.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

17.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

18.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

19.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

20.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

21.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

22.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

23.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

24.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

25.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

26.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

27.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

28.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

29.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

30.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

31.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

32.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

33.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

34.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

35.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

36.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

37.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

38.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

39.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

40.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

41.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

42.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

43.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

44.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

45.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

46.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

47.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

48.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

49.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

50.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

51.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

52.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

53.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

54.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

55.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

56.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

57.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

58.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

59.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

60.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

61.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

62.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

63.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

64.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

65.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

66.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

67.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

68.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

69.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

70.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

71.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

72.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

73.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

74.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

75.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

76.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

77.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

78.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

79.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

80.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

81.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

82.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

83.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

84.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

85.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

86.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

87.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

88.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

89.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

90.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

91.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

92.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

93.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

94.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

95.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

96.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

97.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

98.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

99.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

100.基金经理人姓名发生变更(证监会网站及基金管理人网站)的,以变更后的基金经理人姓名为准。

证券代码:002012 证券简称:凯恩股份 公告编号:2014-029

浙江凯恩特种材料股份有限公司 第六届董事会第十二次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。浙江凯恩特种材料股份有限公司(以下简称“公司”)第六届董事会第十二次会议于2014年7月18日以电子传件方式发出,会议于2014年7月18日以通讯表决的方式召开,会议应到董事8人,实到董事8人,会议由董事长杨卫主持,本次会议的召集、召开和表决程序符合《公司法》及《公司章程》的规定,合法有效。会议决议并通过了如下议案:

一、审议并一致通过了《关于控股子公司浙江凯恩纸业股份有限公司提供财务资助的议案》并提交公司2014年第二次临时股东大会审议,详见会议于2014年7月18日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和巨潮资讯网www.cninfo.com.cn上的《浙江凯恩特种材料股份有限公司关于控股子公司提供财务资助的公告》。

二、审议并一致通过了《关于召开公司2014年第二次临时股东大会的议案》。

公司董事会决定于2014年8月4日召开公司2014年第二次临时股东大会,《关于召开公司2014年第二次临时股东大会的议案》载于2014年7月19日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上。

特此公告。

浙江凯恩特种材料股份有限公司 董事会

2014年7月19日

证券代码:002012 证券简称:凯恩股份 公告编号:2014-030

浙江凯恩特种材料股份有限公司 关于对控股子公司提供财务资助的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。浙江凯恩特种材料股份有限公司(以下简称“公司”)为控股子公司浙江凯恩纸业股份有限公司提供财务资助,现将有关事宜公告如下:

一、财务资助概述

为支持控股子公司浙江凯恩纸业股份有限公司(以下简称“凯恩纸业”)的发展,公司拟增加对凯恩纸业的财务资助金额。2013年12月12日召开的公司的2013年第三次临时股东大会审议通过了《关于对外提供财务资助的议案》,决定对凯恩纸业提供不超过4,000万元的财务资助,现将该余额调整为不超过5,000万元。资金占用期间为公司借款利率上浮5%。上述财务资助主要用于凯恩纸业的短期资金周转,在上述额度内财务资助金额可循环使用,单笔财务资助期限不超过一年,本次财务资助事项有效期自2014年第二次临时股东大会通过之日起至2015年度股东大会审议通过后的凯恩纸业提供财务资助事项解除止。

上述财务资助事项已经公司第六届董事会第十二次会议和第六届监事会第九次会议审议通过,上述财务资助事项已于2014年第二次临时股东大会审议通过。

二、资助对象的基本情况

1. 资助对象名称:浙江凯恩纸业股份有限公司

2. 公司全称:浙江凯恩纸业股份有限公司

3. 注册资本:2,000万元

4. 法定代表人:叶皓

5. 成立日期:2003年8月28日

6. 注册地址:龙游县龙洲经济开发区纸制品工业园区

7. 经营范围:造纸、加工纸制品、销售、机械加工、销售、造纸原料、化工产品(不含危险品)的销售。(涉及许可经营的须取得许可)

8. 公司持有凯恩纸业60%股权,自然人叶皓持有凯恩纸业40%股权,叶皓为公司董事长,除此之外,与公司控股股东、实际控制人不存在其他关联关系。

截至2014年6月30日,凯恩纸业总资产304,371,059.69元,净资产171,502,275.91元,2014年上半年实现净利润10,533,601.02元(以上数据未经审计)。

三、资助的用途

凯恩纸业为自然人股东叶皓为公司董事长,为本次财务资助提供连带责任保证。

四、接受财务资助对象的其他义务

凯恩纸业的第一大股东为自然人,资金有限,因此本次财务资助由公司单方面提供,公司利益没有受到损害。

五、董事会有利于凯恩纸业的主营业务的拓展,提升其生产经营能力,提供财务资助具有必要性。凯恩纸业经营良好,具有较好偿债能力,上述财务资助定价公允,不存在损害公司和中小股东利益的情形,没有对公司的生产经营造成不利影响。

六、独立董事意见

浙江凯恩纸业股份有限公司(以下简称“凯恩纸业”)为控股子公司,公司为其提供财务资助有利于凯恩纸业主营业务的拓展,提升其生产经营能力,提供财务资助具有必要性。

公司本次对凯恩纸业提供财务资助事项符合《公司法》、《公司章程》、《深圳证券交易所股票上市规则》和《中小企业板信息披露业务细则》等相关规定,本次财务资助符合公司《章程》非公开发行股票的相关规定,且风险可控范围内,不存在损害公司和中小股东利益的情形,不会对公司的生产经营造成不利影响,我们一致同意公司本次提供财务资助事项。

5.3 报告期末按行业分类的股权投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	321,515.64	0.02
B	采矿业	357,182.07	0.02
C	制造业	183,366,446.13	1.07
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	62,208,364.18	3.69
E	建筑业	20,555,288.56	0.12
F	批发和零售业	17,617,260.02	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	7,047,687.19	1.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	12,902,647.40	0.77
J	金融业	84,352,266.68	5.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,237.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	800,142.00	0.05
O	房地产业、教育和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	670,000.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	85,500.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	390,021,870.74	23.13

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权投资组合

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	600703	三安光电	2,354,197	53,424,669.71	3.17
2	600578	节能电力	11,172,554	36,869,428.20	2.19
3	601328	交通银行	8,391,756	32,520,013.28	1.93
4	600580	江铃汽车	827,430	23,683,201.40	1.41
5	601089	众泰汽车	2,623,286	21,143,683.38	1.25
6	601668	中国铝业	1,877,204	19,788,515.28	