交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十四日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银周期回报灵活配置混合	
基金主代码	519738	
交易代码	519738(前端)	519739(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年5月22日	
报告期末基金份额总额	447,853,977.14份	
投资目标	本基金以交银施罗德投资时钟分析框架为基础,结合基金管理人对宏观经济周期和金融市场运行趋势的判断,通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理,在控制下行风险的前提下,力争为投资者提供长期稳健的投资回报。	
投资策略	本基金充分发挥资产管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上,运用交银施罗德投资时钟分析框架,自上而下调整基金大类资产配置比例和股票行业配置比例,确定债券组合久期和债券类别配置;在严谨深入的股票和债券研究分析基础上,自下而上精选股票和债券。	
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其长期平均风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,378,899.38
2.本期利润	27,079,618.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0514
4.期末基金资产净值	475,188,805.62
5.期末基金份额净值	1.061

注:1.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,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字;
2.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。

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	5.36%	0.28%	6.84%	0.45%	-1.48%	-0.17%

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

交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年5月22日至2014年9月30日)

注:本基金基金合同生效日为2014年5月22日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2014年9月30日,本基金尚处于建仓期。

§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		
李永兴	本基金、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2014-05-22	-	8年	李永兴先生,经济学硕士。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部研究员、基金经理助理。
项廷锋	本基金、交银双利债券、交银稳安保本混合、交银安祥保本混合、交银定期支付双息平衡混合、交银荣泰保本混合的基金经理,公司投资总监	2014-06-03	-	15年	项廷锋先生,上海交通大学管理学博士。历任华安基金管理有限公司研究员、固定收益投资经理和基金经理。其中2003年12月至2007年5月担任华安现金富利投资基金基金经理。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任固定收益部总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,对于交易所公开竞价交易,遵循"时间优先、价格优先、比例分配"的原则,全部通过交易系统进行比例分配;对于非集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,遵循"价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

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,本公司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没有超过该证券当日总成交量5%的情形,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在本报告期内,经济运行仍延续第4季度以来的趋势,PMI显示内需相对低迷,经济增长动能仍较乏力,另一方面,受益价下行和国际因素影响,CPI仍在继续回落,经济运行的"新常态"已逐步被市场广泛认可;投资者对改革无满预期与期待,而改革的层层推进和系列举措的相继出台并推进落实,又反过来进一步强化了投资的预期与期待,市场因此而出现"股债双牛"局面。

就组合管理而言,本基金受处于建仓期等因素的制约,管理过程并没有充分体现基金管理人对市场的预判,管理绩效有所影响。

展望四季度,经济有望实现8月触底后的温和反弹,通胀压力年内仍不明显。因此,比较而言,技术面可能对市场构成一定的约束。同时,美联储政策影响下美元指数的走势和沪港通的实施,也可能在预期层面对市场产生一定的影响。不过,四季度也是估值切换、布局来年的时间点,就来年而言,我们仍充满期待。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.061元,本报告期份额净值增长率为5.36%,同期业绩比较基准增长率为6.84%。

§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	181,145,156.20	29.09
	其中:股票	181,145,156.20	29.09
2	固定收益投资	416,666,011.95	66.92
	其中:债券	416,666,011.95	66.92
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,648,817.05	1.07
7	其他资产	18,166,684.04	2.92
8	合计	622,626,669.24	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	979,200.00	0.21
B	采矿业	-	-
C	制造业	106,536,684.05	22.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,828,430.66	1.23
E	建筑业	7,748,000.00	1.63
F	批发和零售业	2,960,000.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	3,135,313.50	0.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,095,068.31	3.60
J	金融业	3,090,000.00	0.65
K	房地产业	13,002,707.78	2.74
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	6,502,463.90	1.37
R	文化、体育和娱乐业	14,267,288.00	3.00
S	综合	-	-
	合计	181,145,156.20	38.12

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	600584	长电科技	1,117,527	13,343,272.38	2.81
2	601989	中国重工	2,000,000	13,120,000.00	2.76
3	300291	华录百纳	282,060	11,225,988.00	2.36
4	603328	依顿电子	407,749	10,621,861.45	2.24
5	300074	华平股份	502,771	9,356,568.31	1.97
6	002568	百润股份	226,100	9,202,270.00	1.94
7	002008	大族激光	466,061	9,111,492.55	1.92
8	002081	金 螳 螂	400,000	7,748,000.00	1.63
9	000927	一汽夏利	1,574,200	7,634,870.00	1.61
10	002665	首航节能	150,000	6,604,500.00	1.39

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	10,180,000.00	2.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,072,000.00	6.33
	其中:政策性金融债	30,072,000.00	6.33
4	企业债券	376,027,547.95	79.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	386,464.00	0.08
8	其他	-	-
9	合计	416,666,011.95	87.68

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	1380299	13围城发债	500,000	51,450,000.00	10.83
2	1480338	14示海债	500,000	51,400,000.00	10.82
3	124785	14青州债	500,000	51,300,000.00	10.80
4	1480316	14一师新鑫债	500,000	51,110,000.00	10.76
5	124807	14金国发	500,000	50,052,547.95	10.53

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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	78,117.02
2	应收证券清算款	8,582,390.94
3	应收股利	-
4	应收利息	9,407,653.91
5	应收申购款	98,522.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,166,684.04

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存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	300074	华平股份	9,356,568.31	1.97	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	553,411,391.55
本报告期基金总申购份额	53,234,789.71
减:本报告期基金总赎回份额	158,792,204.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	447,853,977.14

注:1.如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;
2.如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

依据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)的有关规定和《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》的指导意见,经与基金托管人协商一致,本基金对其所持有的华策影视(证券代码:300133)股票自2014年8月21日起按照指数收益法进行估值,并于2014年10月10日起恢复按市场价格进行估值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会核准交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2.《交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金合同》;
3.《交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
4.《交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
5.关于申请募集交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书;
6.基金管理人业务资格批件、营业执照;
7.基金托管人业务资格批件、营业执照;
8.报告期内交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@ysld.com。

南方理财60天债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014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2014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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方理财60天债券	
交易代码	202305	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年10月19日	
报告期末基金份额总额	886,607,257.60份	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在180天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	南方理财60天债券A	南方理财60天债券B
下属两级基金的交易代码	202305	202306
报告期末下属两级基金的份额总额	875,503,804.03份	11,103,453.57份

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"南方理财60天"。

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)	
	南方理财60天债券A	南方理财60天债券B
1.本期已实现收益	10,377,687.30	443,123.43
2.本期利润	10,377,687.30	443,123.43
3.期末基金资产净值	875,503,804.03	11,103,453.57

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方理财60天债券A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2144%	0.0135%	0.3456%	0.0000%	0.8688%	0.0135%

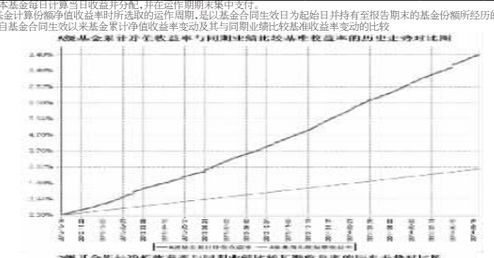
南方理财60天债券B

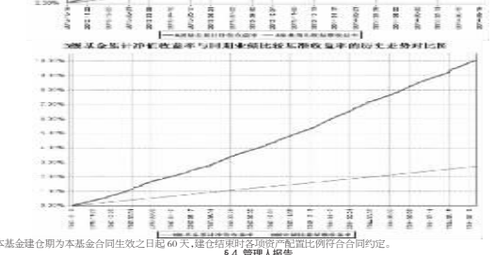
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2878%	0.0135%	0.3456%	0.0000%	0.9422%	0.0135%

注:1.本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

2.本基金计算份额净值收益率时所选取的运作周期,是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金建仓期为本基金合同生效之日起60天,建仓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		
夏爵曦	本基金基金经理	2012年10月19日	-	9	香港科技大学理学硕士,具有基金从业资格。2005年5月加入南方基金,曾担任金融工程研究员、固定收益研究员、风险控制员等职务,现任固定收益部总监助理。2008年5月至2012年7月,任固定收益部投资经理,负责社保、专户及年金组合的投资管理;2012年7月至今,任南方润元基金经理;2012年8月至今,任南方理财14天基金经理;2012年10月至今,任南方理财60天基金经理;2013年1月至今,任南方理财30天基金经理;2014年7月至今,任南方现金通基金经理;2014年7月至今,任南方薪金宝基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确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。

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》等有关法律法规、中国证监会和《南方高端装备灵活配置混合型证券投资基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。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2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

第三季度,"微刺激"的政策环境配合"沪港通"的资金面预期,市场形成了阶段性的底部,并获得不小的涨幅。市场风格呈现多点开花的局面,低估值价值股,尤其是"沪港通"相关标的表现较眼;同时传统行业向新兴经济的转型动作大多得到市场的积极认可;在新股发行有序进行的背景下,低市值个股关注度也热度提升。

报告期内本基金进行了投资方向的转型,投资方向聚焦于国防军工、机械设备、电子、通信和计算机行业这五个行业。通过及时的持仓品种变更,本基金取得较好的投资收益。报告期内本基金的投资领域从"金概油"等周期性行业变更为高端装备制造、电子和计算机等成长性行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末,本基金份额净值为1.174元,本报告期(2014年7月24日 — 2014年9月30日)份额净值增长率为16.12%,同期业绩比较基准增长率为13.59%。

截至转型前报告期末,本基金份额净值为1.011元,本报告期(2014年7月1日 — 2014年7月23日)份额净值增长率为2.64%,同期业绩比较基准增长率为3.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度,我国目前正处于经济增长模式的转型期,资本市场的关注点将会更加看重结构转型,而符合转型方向的高端装备、TMT、军工等行业将会长期受到市场的青睐,存在较大的增长空间,市值占比较低的局面会进一步得到改观。操作上未来会保持中性偏高的仓位水平,力争持续为投资者获得超过基准的收益水平。

§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	125,816,677.38	65.57
	其中:股票	125,816,677.38	65.57
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	39,279,099.23	20.47
7	其他资产	26,773,434.43	13.95
8	合计	191,869,211.04	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	4,532,838.00	2.39
B	采矿业	5,347,446.75	2.82
C	制造业	76,818,769.58	40.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,177,843.65	2.73
E	建筑业	1,755,275.00	0.93
F	批发和零售业	2,091,518.00	1.10
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	9,502,807.30	5.02
J	金融业	9,041,338.00	4.77
K	房地产业	5,454,290.10	2.88
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	6,094,551.00	3.22
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	125,816,677.38	66.42

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	600406	国电南瑞	284,500	4,873,485.00	2.57
2	601299	中国北车	844,500	4,450,515.00	2.35
3	601989	中国重工	524,402	3,440,077.12	1.82
4	600195	中牧股份	210,084	3,241,596.12	1.71
5	600969	郴电国际	194,795	3,130,355.65	1.65
6	600030	中信证券	230,500	3,070,260.00	1.62
7	600006	东风汽车	531,900	3,063,744.00	1.62
8	300124	汇川技术	101,300	3,048,117.00	1.61
9	300070	碧水源	99,300	3,004,818.00	1.59
10	000402	金融街	466,300	3,002,972.00	1.59

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,741.22
2	应收证券清算款	7,688,425.49
3	应收股利	-
4	应收利息	9,761.79
5	应收申购款	19,058,505.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,773,434.43

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

转型前:南方金粮油商品股票型证券投资基金

报告期(2014年7月1日 — 2014年7月23日)

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	38,936,448.87	86.99
	其中:股票	38,936,448.87	86.99
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,919,451.56	10.99
7	其他资产	901,569.53	2.01
8	合计	44,757,469.96	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	2,854,102.00	6.43
B	采矿业	3,150,040.00	7.10
C	制造业	32,103,081.87	72.32
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	-	-
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	829,225.00	1.87
J	金融业	-	-
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	-	-
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	38,936,448.87	87.72

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	002004	华邦颐seo	110,436	2,197,676.40	4.95
2	600309	万华化学	112,659	1,740,581.55	3.92
3	600737	中粮屯河	236,168	1,346,157.60	3.03
4	000876	新希望	100,400	1,328,292.00	2.99
5	000998	隆平高科	47,000	1,292,500.00	2.91
6	000063	中兴通讯	93,900	1,237,602.00	2.79
7	002250	联化科技	83,544	1,237,286.64	2.79
8	002215	诺普信	164,402	1,226,438.92	2.76
9	002378	章源钨业	64,017	1,206,720.45	2.72
10	000525	红太阳	85,595	1,180,355.05	2.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,418.57
2	应收证券清算款	869,129.68
3	应收股利	-
4	应收利息	12,973.66
5	应收申购款	4,047.62
6