

南方天元新兴产业股票型证券投资基金

2014 第三季度报告

基金净值增长与沪深300指数增长率对比图



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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，或保证投资收益最低。
基金管理人及基金托管人不对因使用本报告所造成的一切后果承担责任。
本报告所载数据截至2014年7月31日，数据截止日期为2014年7月31日。

基金简称	南方天元新兴产业股票
场内简称	南方天元
交易代码	160133
基金运作方式	上市契约开放式(LOF)
基金合同生效日	2014年7月31日
报告期末基金份额总额	1,179,058,444.53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的流动性的前提下，采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中证红利指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型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. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	46,884,319.81
2.本期利润	163,181,010.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0645
4.期末基金资产净值	1,236,706,076.04
5.期末基金份额净值	1.0491

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	46,884,319.81
2.本期利润	163,181,010.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0645
4.期末基金资产净值	1,236,706,076.04
5.期末基金份额净值	1.0491

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	46,884,319.81
2.本期利润	163,181,010.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0645
4.期末基金资产净值	1,236,706,076.04
5.期末基金份额净值	1.0491

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	46,884,319.81
2.本期利润	163,181,010.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0645
4.期末基金资产净值	1,236,706,076.04
5.期末基金份额净值	1.0491

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	46,884,319.81
2.本期利润	163,181,010.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0645
4.期末基金资产净值	1,236,706,076.04
5.期末基金份额净值	1.0491

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

南方稳健成长证券投资基金

2014 第三季度报告

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，或保证投资收益最低。
基金管理人及基金托管人不对因使用本报告所造成的一切后果承担责任。
本报告所载数据截至2014年7月31日，数据截止日期为2014年7月31日。

基金简称	南方稳健成长混合
场内简称	南方稳健
交易代码	202001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2001年9月28日
报告期末基金份额总额	3,819,695,919.34份
投资目标	本基金为稳健成长型证券投资基金，在控制风险并保持良好的流动性的前提下，力争为投资者提供稳定的资本增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证红利指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型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. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,523,058.43
2.本期利润	311,943,164.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0791
4.期末基金资产净值	3,494,617,929.94
5.期末基金份额净值	0.9149

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,523,058.43
2.本期利润	311,943,164.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0791
4.期末基金资产净值	3,494,617,929.94
5.期末基金份额净值	0.9149

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,523,058.43
2.本期利润	311,943,164.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0791
4.期末基金资产净值	3,494,617,929.94
5.期末基金份额净值	0.9149

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

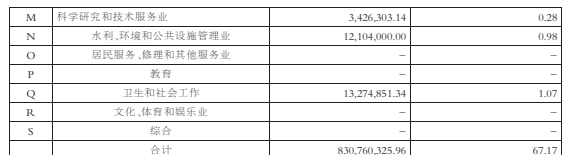
3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,523,058.43
2.本期利润	311,943,164.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0791
4.期末基金资产净值	3,494,617,929.94
5.期末基金份额净值	0.9149

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

南方稳健成长贰号证券投资基金

2014 第三季度报告



基金简称	南方稳健成长贰号混合
场内简称	南方稳健贰
交易代码	202002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月25日
报告期末基金份额总额	6,619,057,340.15份
投资目标	本基金为稳健成长型证券投资基金，在控制风险并保持良好的流动性的前提下，力争为投资者提供稳定的资本增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证红利指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型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. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,094,853.23
2.本期利润	302,030,947.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	3,326,037,342.42
5.期末基金份额净值	0.5025

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,094,853.23
2.本期利润	302,030,947.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	3,326,037,342.42
5.期末基金份额净值	0.5025

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,094,853.23
2.本期利润	302,030,947.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	3,326,037,342.42
5.期末基金份额净值	0.5025

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,094,853.23
2.本期利润	302,030,947.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	3,326,037,342.42
5.期末基金份额净值	0.5025

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

南方稳健成长贰号证券投资基金

2014 第三季度报告

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，或保证投资收益最低。
基金管理人及基金托管人不对因使用本报告所造成的一切后果承担责任。
本报告所载数据截至2014年7月31日，数据截止日期为2014年7月31日。

基金简称	南方稳健成长贰号混合
场内简称	南方稳健贰
交易代码	202002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月25日
报告期末基金份额总额	6,619,057,340.15份
投资目标	本基金为稳健成长型证券投资基金，在控制风险并保持良好的流动性的前提下，力争为投资者提供稳定的资本增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证红利指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型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. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,094,853.23
2.本期利润	302,030,947.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	3,326,037,342.42
5.期末基金份额净值	0.5025

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,094,853.23
2.本期利润	302,030,947.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	3,326,037,342.42
5.期末基金份额净值	0.5025

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,094,853.23
2.本期利润	302,030,947.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	3,326,037,342.42
5.期末基金份额净值	0.5025

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

注：1. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。
2. 本基金投资范围包括股指期货等金融衍生品，其投资应符合中国证监会有关规定，并不得用于投机套利。

3.1 主要财务指标
单位：人民币元

主要财务指标	报告期
1.本期已实现收益	125,094,853.23
2.本期利润	302,030,947.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	3,326,037,342.42
5.期末基金份额净值	0.5025

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，计入持有人实际收益水平时须予以扣除。

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
K	房地产业	48,215,345.71	1.76
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,138,759.16	0.44
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	1,096,129,998.47	40.05

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	601607	上海医药	8,303,082	103,990,285.98	3.80
2	600583	海油工程	13,039,395	96,361,129.05	3.52
3	603118	中国平安	1,499,905	59,156,253.20	2.16
4	002557	浔泰药业	3,108,250	52,844,840.00	1.93
5	002594	比亚迪	1,069,210	51,215,159.00	1.87
6	600511	国药股份	2,044,484	45,939,555.48	1.69
7	002331	松辽科技	3,615,444	40,276,278.88	1.48
8	601601	中国太保	1,999,961	35,519,376.36	1.30
9	600240	华远地产	7,111,456	33,779,416.00	1.23
10	002241	聚尔孚	1,107,919	30,024,604.90	1.10

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	1,308,447,000.00	47.81
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	5,758,463.20	0.21
8	合计	1,344,532,463.20	49.13

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	130428	13债28	2,500,000	250,450,000.00	9.15
2	140208	14债08	2,000,000	203,600,000.00	7.42
3	120204	12债04	2,000,000	199,100,000.00	7.27
4	120226	12债26	1,800,000	180,036,000.00	6.58
5	130227	13债27	1,600,000	160,016,000.00	5.85

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	130428	13债28	2,500,000	250,450,000.00	9.15
2	140208	14债08	2,000,000	203,600,000.00	7.42
3	120204	12债04	2,000,000	199,100,000.00	7.27
4	120226	12债26	1,800,000	180,036,000.00	6.58
5	130227	13债27	1,600,000	160,016,000.00	5.85

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	130428	13债28	2,500,000	250,450,000.00	9.15
2	140208	14债08	2,000,000	203,600,000.00	7.42
3	120204	12债04	2,000,000	199,100,000.00	7.27
4	120226	12债26	1,800,000	180,036,000.00	6.58
5	130227	13债27	1,600,000	160,016,000.00	5.85

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	130428	13债28	2,500,000	250,450,000.00	9.15
2	140208	14债08	2,000,000	203,600,000.00	7.42
3	120204	12债04	2,000,000	199,100,000.00	7.27
4	120226	12债26	1,800,000	180,036,000.00	6.58
5	130227	13债27	1,600,000	160,016,000.00	5.85

报告期末管理人持有的本基金份额	41,475,711.70	
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	3.52	
本基金管理人基金管理人持有或管理的全部基金中持有的本基金情况		
1. 本基金管理人基金管理人持有本基金的情况		
1.1 基金管理人持有本基金的情况(单位: 元)		
1.1.1 基金管理人持有本基金的情况(单位: 元)		
报告期末管理人持有的本基金份额	44,335,529.00	单位: 元
报告期间买入/申购总份额	0.00	
报告期间卖出/赎回总份额	0.00	
报告期末管理人持有的本基金份额	44,335,529.00	
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	1.48	