:接A30	0版)		
		注册地址:西安市高新区辖业路1号都市之门B 座5层	
81	开源证券有限责任公司	办公地址:西安市高新区辖业路1号都市之 门B庭5层 法定代表人:李刚 联系人:王蛟 电话:029-68633210 029-88365809	
82	中邮证券有限责任公司	传统 (329-88447322 容限 151 - 400-960-9866 原理 151 - 400-960-9866 建設 建设 持续 150 - 400-960 是 250-96	
83	中国民族证券有限责任公司	西東 1999年(2015年)	
84	诺亚正行(上海)基金销售投资照 间有限公司	関連、www.6518.com は野地址上、店町北口 区 実践第360寿9与3724室 力を地址、上海粉画匠 常量高路32号 C林2 提 建富人、字号 电信、021-38607750 方面 (021-38607750 方面 (021-38607750 を選札後、1400-821-53090	
85	深圳众禄基金销售有限公司	自動地並,但如由等層层原中东路5047号史原框 行大獨25號/排布 为公地並,深圳市罗湖区房南东路5047号史 原任方/厦25號/105-2 東張方大厦25號/105-2 東京人。海峰 東京人。海峰 東京人。2 東京、2 東	
86	上海好买基金销售有限公司	网法。www.diind.cn/www.jimmv.com 建即推达上海市度口区场中路685界3794号楼 449號 办会推出上海市迪索鄉区迪索南路1118号 排水多面间形大股03-9065 排水。从在文域 最高人,张划 电话。(0.21-68590/16 台灣規范,10-700-9665	
87	杭州数米基金销售有限公司	阿兹: www.ehowbuy.com 拉斯·维达.其代析·森杭区 在新资油海南路会2号 办公地址。浙江省时州市郊江区江南大道 被第二人里 1888 被第二人里 1888 市成 1987 — 3885990,021 – 66897869 市成 1987 — 388590,021 – 66890,021 – 66890 市成 1987 — 56890,021 – 66890 市成 1987 — 56890,021 – 66890 市成 1987 — 56890 市成 1	
88	上海长嶽盖金销售投资照问有限 公司	注册地址:上海市油东所区 南州路 5.26号 2億2.20 変 か地址:上海市油东新区 浦东 大道 555号 新駅間原18間で成立 送定代表人、張荻作 最系人。1979年1815 「復嘉」(21-20/91816 客原 电(5,400-089-1299	
89	上海天天基金销售有限公司	阅述, www.erchfund.com 起始生, 上海市金汇区及进路190号2号程2层 办公地址, 上海市金汇区定用路195号3号程 技工代表人, 共享 联系人, 满世女 证据, 023—34509998 宏照电话, 440—1818188 资源电话。 023—034518188	
90	北京限恒基金销售有限公司	注册地址,北京市顺义区后与构筑安富街市号 办会地址,北京市明阳区德胜门外平产北 里2号代建大厦6层 按定人,沿幅沿 设置人,沿电沿 传真,101-6230385 密理电话,40888661 网址,1008-05066	
91	浙江同花順基金销售有限公司	注册地址: 河江省杭州市文三周路 ー号元茂大 別903至 地上, 河江省杭州市東柏路7号 杭州电 か会地電源 東京大、沙湖 東京大、沙湖 東京大、沙湖 東京大、沙湖 東京大、沙湖 東京大、沙湖 東京大、地震 東京大、地震 東京大、地震 東京大、地震 東京大、地震 東京大、地震 東京大、地震 東京大、地震 東京大、地震 東京大、地震 東京大・地 東京大・地 東京大 東京大 東京大 東京大 東京大 東京大 東京大 東京大	
92	中期时代基金销售(北京)有限公司	注 無地性 志 京 京 朝阳区 城田 (1) 外 元 年第 14 号 1	
93	万银财富(北京)基金销售有限公司	注册单址。北京市朝阳区《巴环中路27号院5号 结3201内 办公地址。北京市朝阳区北巴环中路27号院 5号信3201内 建亚代表人。李绍弟 联系人,刘昭 电话。610~593930274 客限记号。4008080009 则此。www.y~find.com	
94	和讯信息科技有限公司	注册地址,北京市朝阳区朝外大街22号泛利大 〒10届公地址,北京市朝阳区朝外大街22号泛利 天旗10届 进在代章人,王朝 联系人,证明 电话,021-20835789 传海(075-80209055 客报记号,4092200022 网地,后848-69020022	
95	宜信誊添投资则同(北京)有限公 司	注册地处,北京市朝阳区独国路88号9号楼15层 1899 办会地址,北京市朝阳区建国路88号SOHO 現代版区第1809 经定代表入,这件样 联系人,接侧 电压,406099200 传真,010~88994285 客服机器,40099550	
96	浙江金观域财富管理有限公司	所述, www.ysinfund.com 注册地址, 其相可测压度 扩影 18号 世贸 删局 域改美中心。1号度 (DK) 801 第 力心地址, 使州市西周区 发工路 18号 世贸 圖 結成改中心。1号程 (DK) 801 第 由定 19元人,则基 电压。19元子 18-623917 传真。6371—5629971 客型 电活,497—668—6058 增生,1989—1989—1989—1989—1989 增生,1989—1989—1989—1989—1989—1989—1989—1989	
:接A3	2版)		
-J y A3.	瑞银证券有限责任公司	注册地址,北京市四域区金融大街7号美蓝 (国际金融中心12层 15层 实现公地址,北京市园域区金融大街7号 英亚 (北京市园域区金融大街7号 联宏北美大,和宣本 联系人,和中 联系电信1010—58228112 安照电话;400—887—8827 公司得到、www.ubsecunities.com	
1		客服电话:400-887-8827 公司网站:www.ubssecurities.com	

97	泛华普益基金销售有限公司	注册地址,四川省成都市成年区建设路9号高地中心1101室 办公地址,四川省成都市成年区建设路9号 高地中心1101室 进业代表人,于海锋 联系人,不勝
		电话:13981713068 传真:028-82000996-805 容服电话:400-8588588 同姓:http://www.pyfund.cn 注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46
98	嘉实财富管理有限公司	様の6-10年元 かな物は上海市浦东新区世紀大道8号B 総46億0-010年元 単立代表人、起学平 東系人、根理 単近、121-2028/899 作成。(221-2028/899 円成。(241-2028/899) 関北 voww.hursetwa.cn
99	深圳市新兰德证券投资咨询有限 公司	注册地止深即市福田区中强北路塘悠科技四4 括10层10066 办公地址。北京市西域区金融大街35号团企 大厦《田9园 进业化表人,陈撰 展系人,邓宝文 电话。610~58325395 传第401~58325392 宏觀址话。4088507771 灣地。由即学行到500m
100	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册维此。或市经济技术开发区包达北路10 亏证易122至 办公地址。北京市朝利区东三环中路20号层 成中心入租23里 进程化表人、集整 电压(500—57756019 传黄(100—57756199 密限电话。400—786-8868—5 對此等。如此话,400—786-8868—5 對此等。如此话,400—786-8868—5 對此等。如此話,400—786-8868—5 對此等。如此就而在500
101	北京钱服财富投资管理有限公司	注册地址,北京市海底区丹梭街6号1幢9层 1088-1012 分之地址,北京市海底区丹楼街6号1幢9层 1088-1012 进址代表入,起荣 地质,010-57418829 传黄,010-57569671 宏原北语,400-678-5095 別址,5400-678-5095 別址,5400-678-5095 別址,5400-678-5095
102	深圳联合货币基金销售有限公司	拉普地上,得到市南山区粤州二道6号家以大學 探測产等所大樓BB15的人以推深而百萬商商 畅节有限公司 鱼田商220号位原的南大 (深到市值间区 鱼田商220号位原的南大桥人, 上海255—2500176 位 克。1075—8800185 高麗 电话,100005581 同处 twww.actfud.com
103	深圳前海汇联基金销售有限公司	油粉地上,深即市南山区粤州二温6号武仪大学深圳产等每次推815 为全地上,深即市福田区金田第2028号型揭商 寿中心4楼法定代表人,丁海 東系人,架劃衛 東系人,第20 東京人,第20 東京人,第20 東京人,第30 東京人,第50 東京人 東京人 東京人 東京人 東京人 東京人 東京人 東京人
104		兄详见基金管理人发布的相关公告。
南方基金 住所及 层 层 法定代。 电话:((登记机构 金管理有限公司 办公地址:深圳市福田中心区 表人:吴万善 0755)82763849 0755)82763889	《福华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、3
联系人:		

上海源泰律师事务所

(二)准卯事分所私经少年卯上油源家律帥事务所 注册地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼 负责人,廖南 电话:(021)51150298 传真:(021)51150298 经办律师,黎明,田卫红 (二)会计师事务所和经办注册会计师 名称:晋华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 在所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 执行事务合伙人,杨绍信 联系人)陈蒙 联系(1)陈蒙 联系(1)陈蒙 联系(2)2323880 经办会计师:薛宽、陈藤 四、基金名称 南方隆元产业主题股票型证券投资基金 五、基金的类型 契约型开放式

六、基金的投资目标

六.基金的投资目标 本基金为年极型股票基金,在准确把握产业发展趋势和市场运行态势的基础 ,集中精选具备面积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 投资组合风险,追求较高的超额收益与长期资本增值。 七.基金的投资方向 本基金的投资方间 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法公开 行、上市的股票和债券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工

具。 本基金投资组合为;股票占基金资产的60%—95%,其中对具备"国民经济三大产业 走廊的优势行业和上市公司的投资不低于股票投资比例的80%。债券、货市市场工 具及其他金融工具占基金资产的60%—95%;权证占基金资产净值约0—3%;资产支持 证券占基金资产净值的0—20%;基金保留的现金以及到明日在一年以内的政府债 势的比例合计不低于基金资产净值的9%。 如法律法规或监管组构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适 与程序后可以将其纳人投资范围;如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例 限制的,基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定,不需经基金份额持有 人大会计及

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。
(一)资产配置策略
(一)资产配置第二次。
(一)资产配置的工作。
在资产配置,基金管理人的研究部门根据对国际国内宏观、微观经济运行状态、证券市场走势和估值水平、政府财政政策、货币政策、产业政策等方面的研究。提出关于资产配置的研究投告和关于资产配置的参考性建议,投资决策委员会将根研实产产配置的研究投告和关于资产配置的参考性建议,投资决策委员会将根研实产产配置的研究设计,从1一大学业主题
在新一轮产业生器
在新一轮产业结构调整和产业升级中、发展先进制造业、提高现代服务业化重和制造业、现代服务业和基础产业升级中、发展先进制造业、提高现代服务业化重和制造业、现代服务业和基础产业的投资主题组基本基金所指的三大"产业主题"
先进制造业、现代服务业和基础产业的投资主题组基本基金所指的三大"产业主题"

高速增长的发动机及国家竞争力的主要体现。作为制造业赖以生存和发展的先进制造业、将在中国走新型工业化道路、全面建设小康社会、迈向制造强国的进程中起关键性作用。本基金所指的先进制造业主要包括采用先进的技术设备和现代化的管理手段、具有较高科技含量的上市公司。

的管理手段、具有较高科技含量的上市公司。 现代服务业:服务业是国民经济的重要组成部分,其发展尤其是现代服务业的 及展是衡量经济、社会现代化水平的重要标志。大力发展现代服务业步加快工业 化、现代化的必然要求,对于促进国民经济协调发展、提高经济效益。扩大劳动就 业、加块规键化进程、设备人民生活结构着重工作用。 本基金新用的现代服务业 要包括运用现代经营方式和信息技术手段、代表服务业发展方向的上市公司。 基础产业、基础产业在国民经济技厂中少于基础地位、是支撑社会经济运行的 基础产业水平和反顺着国民经济活动的发展方向与它行速度。是其他产业赖以存在 和发展的前提。本基金所指的基础产业主要包括能源、交通、原材料等国民经济基础行业的上市公司。

基础,它决定和反映着国民经济活动的发展方向与运行速度,是其他产业懒以存在和发展的前继,本基金所指的基础产业主要包括能源、交通、原材料等国民经济基础行业的上市公司。
2. 行业展置销略
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、收益预测,行业经济政策面高速,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的转边和监查,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价等应收。超额收益率或顶侧超额收益率水平较高的行业价重点投资。本基金采用的行业分类是已以解根斯坦利标准普尔公司联合发布的全球行业分类标准记(515)为基础。参照中国证金发布的上市公司标合发布的全球行业分类标准(10(5)为基础。参照中国证金发布的上市公司行业分类相互财富介度,首次对各行业价处资价值评估体系"。该体系引人"行业平价的配置打分类",首先对各行业评价综合性的相对吸引度分数。然后以各行业产价配置扩分推广到整、形成"陶方基金行业投资价值评估体系"。该体系引人"行业中价配置打分推准",首次对各行业评价综合性的相对吸引度分数。然后以各行业产市场中所占比例为基础。依据吸引度分数进行配置比例的调整。吸引度分数的部分体理主要将认了几万面。研究基本面信息,例如,行业竞争优势,市场结构、行业的价格收益比、行业成长性、行业内大部分上市公司经营是否健康等。于企业的历史表现,是否经过大部概念沙作。分析员对收益的预期;宏观经济。政策面、例如,政府的行业收支及行业政策,方即的对金、发生分量的权宜,对各行业位方综合的权宜,对各行业位方综合的权宜,对各个对金、由于各个因素的有效性会相时间变化。各行业的吸引度分数进行能合,由于各个因素的有效性会和更多的,其代表的可以是另一个人。由于各个因素的有效性会和更多,由于各个因素的自然,其优格和可以是另一个人。由,其优格和可以是有一个人。由,其优格和可以是是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因为是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各个因素的可以是一个人。由于各种区的是一个人。由于是一个人。由于是一个人,由于是一个人。由于是一个人,由于是一个人。由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人。由于是一个人,由于是一种的工作,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一个人,由于是一种的关系的,由于是一种的,由于是一种的对于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,是一种的,由于是一种的,是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,由于是一种的,是一种的,由于是一种的,由于是一种的,是一种的,由于是

例的调整。本基金对优势行业配置,再配置的过程同时是对优势行业动态调整的过程。 经济的发展是一个动态的过程。在不同的历史时期,不同的宏观背景,不同的 产业政策下。国际经济三大产业中各行业板块的发展态势有所不同。本基金将捕捉 限制度经济三块产业中各行业板块的发展态势有所不同。本基金将捕捉 化酒时调整,以更好把据优势行业。 本基金将按照 "行业评价配置打分表"的内容定期或不定期地对各行业进行 评分,则除评级下降的行业,同时积极投资于评级明显上升的行业。 3、个股选择策略 石资产配置,行业配置完成后,本基金管理人主要从以下几个方面评估行业内 的上市公司。

3.个股选择镇略
在资产配置行业配置完成后,本基金管理人主要从以下几个方面评估行业内的上市公司:
公司的商业模式;
产品市场前费分析,包括产品本身市场分析、主要竞争对手、上下游产品关联性及定价能力,替代产品分析等;
公司的核心竞争力分析,包括管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌。重要客户等;
公司的参以及及财务管理能力,包括财务安全性指标,反映行业特性的主要财务指标,公司股权与债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等;
公司财务状况及财务管理能力,包括财务安全性指标,反映行业特性的主要财务指标,公司股权与债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等;
公司财务状况及财务管理能力与成本分析、公司用投资收益率分析等;
公司财务状况及财务管理能力,包括财务安全性指标,反映行业特性的主要财务指标、公司股权与债权融资能力,从可用投资的债务。本基金有在所判别率走势的基础上做出最佳的资产配置及风险控制。在选择债券品种时,本基金重点分析债券及行人的债信品质、包括安行机构以及保证机构的偿债力、财务结构与安全性、并根据对不同期限品种的研究、构造收益率曲线、采用久期模型构造最佳债券期限组合,降低利率风险;对可转债的投资,结合对股票走势的判断。及规其套利机会。

能力。对对否合型文主证,开始级外不可期效而补引的对人自动、松重型、杂户的判断、发现具套的相关。
(四)权证投资策略
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型导来其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括。杠杆策略、价值按照策略、获利保护策略、价差策略、观向权证策略、卖全保护性的认为权证策略等。
水利保护策略、价差策略、观向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买人保护性的认为私证策略等。
本公司将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属资格,磺酸进行投资。追求较稳定的当期收益的证券投资基金品种,其预期风险和规则收益的证券投资基金品种,其预期风险和规则收益的证券投资基金品种,其预期风险和规则或益本可产者是发展。属于较高规制规、应和规则的处的证券投资基金品种,其例则风险和股流水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。十、基金业缓比较基准。
65%、本产深300指数,15%、x上证国债指数本基金为股票型基金。在考虑了基金股票组合的投资标的,构建流程以及市场人各个股票指数的编制方法和历史情况后,我们选定评深300指数作为本基金股票组合的业绩基准。产深300指数收价股选自沪察两个证券市场、覆盖了大部分流通标金风炉等级的编制。并不以各种场域、各个股票特数的编制方法和历史情况后,我们选定评深300指数。上证国债情数是上证债券多额外上市的所有固定利率证债分准允,集格较强价总总依发展趋势。并深300指数成分在和调整的方律本、按照调度发行量加权而成。上证国债情数是上证指数系列的第一只债券指数、反映我国债券市场整体交动状况。具有较强的形成代表性、如果今后法律法规发生变化、或者有更权威的,更能为市场普遍接受的业绩比较基准推由,或者是市场上出现更加强合用于本基金的地域基准的股票指数时,本基金管理人不提出性的影片和关系的发生,是被了各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和各种的影片和企业和基本会全的规划。基金管理人不能以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金。主命的这样出始并不代表其实来来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策的

基金与定人争信以吸头信用、则观尽员印质则旨理和应用建立对广,但个床证基金一定盈利。 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。 本投资组合报告所载数据截至2014年3月31日(未经审计)。 (一)报告期末基金资产组合情况

1	权益投资	2,538,611,320.77	75.18
	其中:股票	2,538,611,320.77	75.18
2	固定收益投资	230,252,000.00	6.82
	其中:债券	230,252,000.00	6.82
	资产支持证券	-	_
3	贵金属投资	-	_
4	金融衍生品投资	-	_
5	买人返售金融资产	-	_
	其中:买断式回购的买人返售 金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	595,194,240.02	17.63
7	其他资产	12,812,173.84	0.38
8	合计	3,376,869,734.63	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	183,672,994.72	5.50
С	制造业	648,036,605.95	19.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	148,446,079.11	4.44
E	建筑业	42,146,695.92	1.26
F	批发和零售业	127,172,139.56	3.81
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	_
I	信息传输、软件和信息技术服务 业	941,680,356.53	28.20
J	金融业	_	-
K	房地产业	119,549,768.14	3.58
L	租赁和商务服务业	269,014,956.00	8.05
М	科学研究和技术服务业	_	-
Ν	水利、环境和公共设施管理业	15,540,000.00	0.47
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,078,552.00	0.33
R.	文化、体育和娱乐业	50,451.84	0.00
S	综合	32,222,721.00	0.96
	合计	2,538,611,320.77	76.01

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	002065	东华软件	4,620,999	186,503,519.64	5.58
2	600446	金证股份	6,611,291	169,976,291.61	5.09
3	300058	蓝色光标	3,279,030	163,951,500.00	4.91
4	300315	掌趣科技	4,129,460	132,886,022.80	3.98
5	002421	达实智能	5,305,140	118,357,673.40	3.54
6	002595	豪迈科技	2,874,615	106,590,724.20	3.19
7	002400	省广股份	3,283,233	105,063,456.00	3.15
8	000712	锦龙股份	3,467,415	92,892,047.85	2.78
9	300157	恒泰艾普	4,202,683	86,112,974.67	2.58
10	600208	新湖中宝	28,037,879	82,992,121.84	2.48

占基金资产净值比例(%)	公允价值(元)	债券品种
_	-	国家债券
_	-	央行票据
6.89	230,252,000.00	金融债券
6.89	230,252,000.00	其中:政策性金融债
_	-	企业债券
-	-	企业短期融资券
_	-	中期票据
-	-	可转债
_	-	其他
6.89	230,252,000.00	合计

1 140204 14国开04 1,800,000 180,252,000.
2 130322 13进出22 500,000 130322 13进出22 500,000 50,000,000.00 1.50 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 (八) (18日 1877年) 证券投资問題 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。 (七)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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。 (八)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

(八)报告期未按公允的"值占基金资产"中值比例大小非名的削五名权证投资

注:本基金本报告期末未挂夸权证。
(九)报告期未私金投资的配料期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资配料期货。
(十)报告期本未基金投资的固储期货。
(十)报告期本未经免增的国储期货。
(十)报告期本未经查和报告期决未投资国储期货。
(十)投资组合报告制注。
(十)投资组合报告制注。
(十)投资组合报告制注。
(十)投资组合报告制注。
(本是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,或在告编制目前一年内受到公开通费、处罚的证券。
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。

7的股票。
3、其他资产构成

444,364. 9 1.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 生: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

000712 基金的业绩

2010.1.1-2010.12.31 2011.1.1-2011.12.31

-14.26%

013.1.1-2013.12.31 014.1.1-2014.3.31

十三、基金费用概览 十三、基金费用概览 (一)与基验证件有大时费用 1. 基金费用的种类; (1. 基金管理人的管理费; (2. 基金社管人的托管费; (3.) 【基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; (4. 【基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费; (5. 基金的继持有人大会费用; (7. 基金的银行汇划费用; (7. 基金的银行汇划费用;

(8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。 2. 基金费用计提方法,计提标准和支付方式 (1)基金管理人的管理费 本基金的管理教헌前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方

法如下:

H=E×1.5%-当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金
托管人发送基金管理费均以款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金
财产中一次性支付给基金管理人。若迪法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
(2)基金托管人的托管费
本基金的托管费技前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算
方法如下:

本。基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的牛费率订提。11日至0111 FP
方法如下。N 0.25%,当年天数
H = E N 0.25%,当年及
H = E N 0.25%,主
H = E N 0.25

基金對产的預貨工人。 (2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用; (3) 《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验查费。会计师和律师费、 信息披露费用等费用; (4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列人基金费用的项 目。

除非基金合同。相大还年达规以监官机构另有规定;關肽基金管理费率、基金社官 费率等费率、无须召开基金价额持有人大会。 基金管理人必须最迟于新的费率实施目前2日在至少一种指定媒体及基金管 理人网站公告。 (二)与基金销售有关的费用 1、申赐费 本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。本基金提供两种申购费用的 支付模式。本基金在申购时收取的申购费用称为前端申购费用。在赎回时收取的申 购费用称为后端申购费用。基金投资者可以选择支付前端申购费用。或后端申购费 用。 本基金的端申购费用。基金投资者可以选择支付前端申购费用或后端申购费 用。 用。 本基金前端申购费率最高不高于1.5%,且随申购金额的增加而递减,后端申购 费率最高不高于1.8%,且随持有时间的增加而递减,如下表所示: 前端收费:

M≥1000万 i端收费(其中1年为365天) 2年 ≤ N<3

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市 广、销售、注册登记等各项费用。 2、赎回费 赎回费率不高于0.5%,随申请份额持有时间增加而递减(其中1年为365天)。

N>2年
投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。 4 基金的赎回费用在投资者 赎回本基金份额时收取,和除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归人基金财产的比例不得低于25%。 3 7本基金的即向数率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式、基金管理人最迟应于新的费率或收费方式。实施日前2个工作日在至少一条指定媒体及基金管理人网站公告。 4 基金管理人对以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据作为场后别定基金使销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易,电话交易等)等进行基金交易的投资者定则或不定期地开展基金锭销活动,在基金偿销活动制度,核和关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。 5 转换费

定期地开展基金俚销活动,在基金俚销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手线后基金管理人可以适当倾低基金申购费率和基金被回费率。
5.转换费
基金管理人已开通本基金与基金管理人旗下部分基金在直销机构和部分代销机构的基金转换业务,业务规则和转换费用的相关规定详见2008年3月11日发布的(关于南方能元产业主题基金开展转处多的公告》和其他有关基金转换公告。
(三)其他费用
本基金其他费用根据相关法律法规执行。
一四、对招募说明书更新分的说明
本基金管理人价据更有的是有关。(证券投资基金运作管理办法》,(证券投资基金运作管理办法》,(证券投资基金销售管理办法》,(证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规约明书进行了更新,主要更新的内容如下:
1.在"基金管理人"部分,更新了主要人员情况。
2.在"基金管理场"。2.在"基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招帮说明书进行了更新,主要更新的内容如下:
1.在"基金管理人"部分,更新生产更是人情况。
2.在"基金管理人"部分,对基金任营人的"主要人员情况"、"基金任营业务经营情况"及"基金在任营人的内部坚制加度"进行了更新。
3.在"相关服务机构"部分,对代增银行、代销券商和其他代销机构名单及会计师事务所的办公地址进行了更新。
5.在"基金的业绩"这一章节、补充了本基金最近一即投资量业品。
6.在"基金的业绩"这一章节、补充订本基金最近一即投资组合报告的内容。
5.在"基金的业绩"这一章节、补充订本基金最近一即投资组合报告的内容。
6.在"基金的业绩"这一章节、补充订本基金最近一即投资业组合报告的内容。
6.在"基金的业绩"这一章节、补充订本基金最近一即投资业绩。

南方基金管理有限公司 二〇一四年六月十七日

接A32	版)	
64	瑞银证券有限责任公司	注册地址,北京市四城区金融大街7号英思 国际金融中心12层,15层 及公规址,北京市四城区金融大街7号 英医国际金融中心12层,15层 法近代发大,程立条 联系人,17年 发展上层,40—887—8827 公司网站,www.ubsocurities.com
65	万联证券有限责任公司	往辦地北方 州市大河区球江东岭11号高 德里地广场中标18,19层 办公地址:广州市天河区珠江东路11 号高德里地广场标18,19层 运定代表人:张建军 联系电话,020~38286651 客服电影:400~8888-133 公司阅谢.www.vdva.com.cr
66	国金证券股份有限公司	办公地址;成都市东城根上街95号 法定代表人;和一宏 联系人;刘一宏 联系电话:028-86690126 客庭电话:4006600109
67	财富证券有限责任公司	注册地址、长沙市美等中路二段80号順天 国际财富中心26楼 办公地址、长沙市美等中路二段80号 顺天国际财富中心26楼 注定代录入,蔡一侯 联系人,郭希 家里电话,0731-84403333 公司网站www.cfq.com
68	恒拳证券股份有限公司	注册地址,内蒙古呼和浩特市新城区新华 东街力是 助公地址,内蒙古呼和浩特市新城区 新华东街11号 旅军代表人,庞介民 联系人,王旭华 联系电话,0471-4972343 网址,www.enht.com.en
69	华龙证券有限责任公司	注册地址,並州市城美区东岗西路638号班 第大厦、公地址,並州市城美区东岗西路638 号斯高大厦、李明田 设施工代表人,李晓安 联系人,李明田 电话,0931—4890208 李原电话,4006~89~8888,0931—96661 两址,1999031—889628
70	华鑫证券有限责任公司	注册地址,深圳市福田区金田路4018号安 東大廈28层 201, 190 (b) 中学 大全地址,深圳市福田区金田路4018 号连取大厦28层 201, 190 (b) 单元 法宣代表人,洪东 电话。(7755—\$2083788 传海。(7755—\$2083788 安康电话。(221—3210999),029—
71	日信证券有限责任公司	两胜,www.cfc.com.cn 注册地址,内项占呼和治特市新城区锡林 网络18号 步公地址,北京市西城区侧市口大街 号长安兴础中心西斯11层 战五代表人,孔伯杰 联系上端之形。3991716 公司网络,www.rezq.com.cn
72	中天证券有限责任公司	注册地址,沈阳市和平区光荣街23甲 办公地址,办公地址,沈阳市和平区内 五场路219万届城高部4梯中天证券经负 事业部 送定代表人,马功助 联系人,袁劲按 联系机,袁劲按 张系址后,406180315 公司周卷、www.stockrn.com
73	大通证券股份有限公司	注册地址;让中省大走市沙河区区会展路 129号大量部沙金融中心。建一大集的货大 少分地址,尤着市沙河区会展路12 号大建制货大厦39层 层近代表人,基本成 服务人,建立军 753(14)—39673219 管原(641—39673219 管原电话,4008—160—160
74	天相投资顾问有限公司	注册地址,北京市西域区金融街19号富凯 大厦场地址,北京市西域区新街口外大 技工代表人,林文相 联系人,296 客限电话。101-6604558 公司局证。http://www.tssec.com 公司基立局局。
75	联讯证券有限责任公司	注册地址: 广东省惠州市惠城区
76	东兴证券股份有限公司	注册地址;北京市四城区金融大街5号新新大厦18812—1582 亩市西城区金融大街5号新新大厦18812—1582 兹定代表人,载庆华联系人,添蓬川 电话:010-6655316 传真:010-6655 宏观电话:400888993 网址:www.dxzq.net
77	开源证券有限责任公司	注册地址,四安市高新区馆业路1号都市之 力加速址,西安市高新区馆业路1号都 市之(由县)、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一
78	中邮证券有限责任公司	注册地址,陕西省巴安市牌延路5号陕西电 数信息大理9-11层 办公地址。陕西省西安市唐延路5号形 西部政信息大理9-11层 联系人、9国湾 电话,029-88602138 传真,029-88602135 密限电话,400888005 网址:www.enpsec.com
79	中国民族证券有限责任公司	注册地址,北京市朝阳区北四环中路27号盘古方观,46至40年3月 五十元观,46至40年3月 2号盘古大观,46至40年3月 3号盘古大观,46至40年3月 15年3

· 公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号

联系人:李玲 电话:021-38602750 传真:021-38509777 客服电话:400-821-网址:www.noah-fun

亚正行(上海)基金销售拍顾问有限公司

81	深圳众禄基金销售有限公司	注册地址, ### ## # # # # # # # # # # # # # # #
82	上海好买基金销售有限公司	注册地址,上海市如口区场中路685弄37号 4号楼49空。 4号楼49空。 118号鄂尔多斯图除大厦903~906空 读至代表人,杨文斌 电话,021~5887001 传真,021~5887001 传真,021~6856916 客屋电话,400~700—666 房址;www.chowbuy.com
83	杭州数米基金销售有限公司	注册地址: 杭州市余杭区 台前青道海曙路 东2号 办2地址: 浙江省杭州市滨江区江南 走道宝代表人,除柏青 康系人,接柏青 电话: 0571-28827990,021-60897869 传真: 0571-26698533 客展电话: 4000-766-123 网址: http://www.find12x.n/
84	上海长量基金销售投资瞬间有 限公司	注册地址,上海市浦东新区高翔路526号2 糖 2028.处地址,上海市浦东新区浦东大道 555号 特型图前83年6层 运工代表人,张跃伟 联系人,495号 电话,021-20691845 传真,021-20691846 客展电话,400-089-1289 房址;据400-089-1289 房址;据400-089-1289
85	上海天天基金销售有限公司	注册地址,上海市徐汇区龙田路190号2号 捷2號。少地址,上海市徐汇区龙田路195号 适定代表人,其实 班系人,指世发 电话,021-54509908 传真,021-6485308 客服电话,400-1818188 网址;www.1244567.com.cn
86	北京展恒基金销售有限公司	注册地址;北京市顺义区后沙峪镇安富街6 50.2地址;北京市明阳区德胜门外华 产业里2号比较大厦6层 战亚代表人,闫既杰 联系人,宋昭市 电话,010-62020388 传真,010-62020385 客展电话,4008886661 园址;www.myfund.com
87	浙江同花順基金销售有限公司	注册地址: 辦江省杭州市文二西路一号元 及大厦903至 成大厦903至 和七千商务产业四边楼 建立代表人,凌媚平 联系人,协翼 电话: 0571-88911818-8653 传真: 0571-8890423 客展电话: 4008-773-772 网址: www.5fimd.com
88	中期时代基金销售(北京)有限 公司	注册地址,北京市朝阳区建国门外光华路 14号;1611年115年25市朝阳区光华路16号 中期大厦2层 进定代表人,路瑶 联系人,投资建 电话,010~65807865 传真,010~65807865 传真,010~65807609 网址,1mp7/www.cicofund.com
89	万银财富(北京)基金销售有限 公司	往册地址,北京市朝阳区北四环中路27号 院55%2017 院55%2017 北京市场2017 北京代表人,李招弟 联系人,汉朝 有害,610~5393023 传真,610~5393074 客服电话,400800069 网址:www.y~fund.com
90	和讯信息科技有限公司	注册地址,北京市朝阳区朝外大街22号记 利大厦(105世址,北京市朝阳区朝外大街22 号记为建设建 号记为北京区 号记为《上海 电话,021-2083789 传真,075-80209055 客服电话,4009200022 同址,1626k.hexun.com
91	宜信普泽投资顺问(北京)有限 公司	注册地址;北京市朝阳区建国路88号9号楼 15温 189~地址;北京市朝阳区建国路88号 SOHO现代统统1899 建立代表人,沈伟棒 联系人,提得 电话,4006099200 传真:010—85894285 客服电话,4006099500 网址;www.yisinfiind.com
92	浙江金观诚财富管理有限公司	注册地址: 杭州市西湖区数工路 18号世贸 副品城灰美中。 16 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18
93	泛华普益基金销售有限公司	注册地址:四川省成都市成华区建设路9号 高地中心1012年 高地中心1012年 50年2年2月 50年2年2日 50年2年2日 50年20年20年20年20 50年20年20 50年20年20 50年20年20 50年20年20 50年20年20 50年20年20 50年20年20 50 50 50 50 50 50 50 50 50 50 50 50 50
94	嘉实财富管理有限公司	注册地址;上海市浦东新区世纪大道8号B 最46楼的6-10年元 南市浦东新区世纪大道8 号部46楼的6-10年元 法定代表人起学军 联系人,夏琳 电话,021-2028910 客服电话,400-021-8850 网址;www.harveswm.cn
95	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址: 京明市福田区华强北路赛格科 按图4标102 1000亩 ID 区争强北路赛格科 按图4标102 1000亩 ID 区金融大街35 号值全发区经验层 连定代表人系接 联系人人302文 电话:010-58325395 传真:010-58325395 经真电话:408507771 同址:hmpv//jijc.com

			注册地址:北京市经济技术开发区宏达北 路10号五层5122室
			办公地址:北京市朝阳区东三环中路
	96	北京恒天明泽基金销售有限公	为公址:北京市朝阳区东三环中路 办公址:北京市朝阳区东三环中路 20号乐成中心A座23层 法定代表人,梁越 联系人;陈攀
	96	司	电话:010-57756019
			传真:010-57756199 客服电话:400-786-8868-5
			网址:www.chtfund.com
			注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层
			1008-1012 办公地址:北京市海淀区丹楼街6号1
		北京钱景财富投资管理有限公	幢9层1008-1012 法定代表人,赵荣春 联系人,魏争
	97	北京民東州高汉京昌建刊限公司	联系人: 魏争
			电话:010-57418829
			电话;010-57418829 传真;010-57569671 客服电话:400-678-5095
			四部::www.niuji.net
			注册地址,深圳市南山区粤兴二道6号武汉 大学深圳产学研大楼B815房(入胜深圳市 前海商务秘书有限公司) 办公地 址,深圳市福田区金田路2028号显岗商务
			前海商务秘书有限公司) 办公地
		深圳联合货币基金销售有限公	址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务 中心2405法宣代表人,王清昭
	98	深圳联合货币基金销售有限公司	联系人: 黄晶龙
			ル (ポルリ 相田 仏 近 日 南
			答服 电话:4008955811
			同址:www.ucffund.com
			注册地址,深圳市南山区粤兴二道6号武 汉大学深圳产学研究大楼B815 办公地址,深圳市福田区金田路2028号皇 岗商务中心4楼法定代表人,丁海
			办公地址,深圳市福田区金田路2028号皇
	99	深圳前海汇联基金销售有限公司	
		FG	电话:0755-3293888-6200
			电话:0755-32938888-6200 传真:0755-32938888-5 客服电话:0755-36907366
			四 址: http://www.flyingfund.com.cn/
	100		2详见基金管理人发布的相关公告。
	(二)汪) 吉安其余	H登记机构 - 管理有限公司	
- 1	星所爱苏	公地址:深圳市福田中心区福	华一路6号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层
i	法定代表	人: 吴万善	
!	电话:(0	755) 82763849	
		755)82763854 t:≆⊓mix	
	(三)担任	5和鹏 呆人 接担保有限公司 ::北京市海淀区西三环北路10	
	中国投融	资担保有限公司	
1	生歴地理な	:北京市海淀区西三环北路10 :北京市海淀区西三环北路10	D号筮玉大厦与子俊9层 D吕金玉士眉写字继q目
	法定代表	人:刘新来	0与亚玉八度马干铵5层
	±1;±;•()1(1_88822720	
1	传真:010)-68437040、010-88822729 控明燚	
	(四)律順	市事务所和经办律师	
Į.	广东华南	律师事务所 :深圳市罗湖区笋岗东路1002	
-	生册地址 负责人:≧	::深圳市罗湖区笋岗东路1002	号宝安广场A座16楼G.H室
i	リスス:= 申话:(07	デカト院 55)82687860	
4	传直:(07)	55)82687861	
- 1	经办律师	:杨忠、戴瑞冬 十师事务所和经办注册会计师 毕永道中天会计师事务所(特殊	
	(九)云l 乞称,萼f	T	\$ 华 通 合 ()
1	生757: 上召	3日(相外新区間家)第环胎1318	与年辰银行大厦5份
	办公地址	::上海市湖滨路202号普华永道	帥心11楼
1	以行事务 至玄 / 『	合伙人:杨绍信 #	
í	获示人: P 获系电话	东熹 :021-23238888	
	告直:021	_23238800	
ì	空少会计 加 其全 的	师:薛竟、陈熹 约名称	
	南方恒元	保本混合型证券投资基金	
	五、基金的	的名称 保本混合型证券投资基金 的类别 型证券投资基金	
1	保本混合 其全	型证券投资基金 的投资目标	
	木其全五	巫섫宓鳁凤险的前埸玉 为起	资者提供保本金额的保证,并在此基础上力争
其全	客产的稳	定增值	, or in the property of the party of the par
	し、全土は	7)投資氾围	的人型工具 包括图内化计图4 L 字的名类体
24 EU	HT X4 C	5国证帐会会还其会织资的甘;	的金融工具,包括国内依法发行上市的各类债 的金融工具
23. (1)	本基金根	据中国宏观经济情况和证券市	i场的阶段性变化,按照投资组合保险机制对债
券和	投票的投	资比例进行动态调整。其中,1	现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比
191不	以丁基金 太其全司	対广伊恒的5%。 投资干股指期货等全融衍生T	也显施上矣。 成的阶散性变化,按照投资组合保险机制对债 现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比 具,有关投资比例限制等遵循届时有效的规定
1八1丁	。如弦律	広规以监官机构以归兀计 净差	. 兵,有天投資に例限制寺屋相庙的有效的规定 [金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序
E 0	门上校甘华	由 】 45次 35国	
	八、基金	的投資策略 妥用 信 定 比 例 45 密 43 へ 4	R 险方法(Constant-Proportion Portfolio 。恒定比例投资组合保险不仅能从投资组合资 低于本金的可能性,而且能在一定程度上使保本
Insu	ance.Cl	PPI)来实现保本和增值的目标	。恒定比例投资组合保险不仅能从投资组合资
产配	置的水平	上消除投资到期时基金净值假	于本金的可能性,而且能在一定程度上使保本
基金	分享股市	整体性上涨的好处。	
来调	かい定性	怎么是的一种机次和 人/四人	育敢 安主爾貝通过粉長八紀 担切主払かい
不低		际通行的一种投资组合保险第 风险资产的可放大倍数(风险等	衰略,它主要是通过数量分析,根据市场的波动 类数),以确保投资组合在一段时间以后的价值
是指	于事先设	际通行的一种投资组合保险的 风险资产的可放大倍数(风险到 定的某一目标价值,从而达到	棄略,它主要是通过数量分析,根据市场的波动 乘数),以確保投资组合在一段时间以后的价值 对投资组合保值增值的目的。无风险资产一般
pst t	于事先设置定收益	1际通行的一种投资组合保险的 风险资产的可放大倍数(风险多 定的某一目标价值,从而达到) 类资产,风险资产—般是指股	策略,它主要是通过数量分析,根据市场的波动 模数),以确保投资组合在一段时间以后的价值 对投资组合保值增值的目的。无风险资产一般 理等如经来资本。在其全资本可处土经数的跨
理上前市	臣、18日2 于事先设 固定收益 基金管理 场状况定	(际通行的一种投资组合保险)。 风险资产的可放大倍数(风险到定的某一目标价值,从而达到)。 类资产,风险资产一般是指股! 世人的金融工程小组在定量分。 期出具保本基金资产的智事排	策略,它主要是通过数量分析,根据市场的波动 模数),以确保投资组合在一段时间以后的价值 对投资组合保值增值的目的。无风险资产一般 理等如经来资本。在其全资本可处土经数的跨
理上 前市 金管	基金官5 场状况定 理人投资	里人的金融上程小组在定量分 「期出具保本基金资产配置建) 法第季员会和基金经理作为复	實略,它主要是通过數量分析,根据市场的被迫 換數,以确保投资组合在一段时间以后的价值 均投资组合保值增值的目的,无风险资产一般 票等权益类资产。在基金资产可放大倍数的管 所的基础上,根据户P的数理机制,历史模拟和目 父报告,给出放大倍数的合理上限的建议,供基 全资产率冒物参考。
埋上 前市 金管	基金官场 场状况定 理人投资 如在本基	里人的金融上程小组任定量分 期出具保本基金资产配置建设 决策委员会和基金经理作为基 金存续期内市场出现如股指制	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效,1、以确定的發生合在一种时间以高的效 成功,以确定的强力。 对现象是合保健增值的目的,无风险资产一般 要等以基金资。在基金资产可放大保险的管 新的基础上。根据它PD级理机则,历史根拟和目 及程金始出处大倍数的合理上限的建议,供基 企金资产促置的参考
埋上 前市 金管 的投	,基金官功 场状况定理人投资 如在本基 资范围之	里人的金融工程小组在定量分 原期出具保本基金资产配置建 决策委员会和基金经理作为基 金存续期内市场出现如股指 内,本基金管理人保留调整保 进程、经验是	實務,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 變數,认以衛保投資组合在一段时间以后的价值 付投资组合保值值的目的。无风险资产一般 漂等权益类资产。在基金资产可放大侵数的管 所的基础上,根据CPP的塑理制,历史模拟和目 发展方、给出放大倍数的合型上限的建议,供基 研究等的论金融行生产品且在开放式基金许可 本投资策略的较利。
埋上 前市 金管 的投	,基金官功 场状况定理人投资 如在本基 资范围之	里人的金融工程小组在定量分 原期出具保本基金资产配置建 决策委员会和基金经理作为基 金存续期内市场出现如股指 内,本基金管理人保留调整保 进程、经验是	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效,1、以确定的發生合在一种时间以高的效 成功,以确定的强力。 对现象是合保健增值的目的,无风险资产一般 要等以基金资。在基金资产可放大保险的管 新的基础上。根据它PD级理机则,历史根拟和目 及程金始出处大倍数的合理上限的建议,供基 企金资产促置的参考
理 市 金 的 指 期	,基金官 场外 是 一 是 一 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	里人的金融上程小组化定量分 期出具保本基金资产配置建 决策委员会和基金经理作为基 金存续期内市场出现如股指 切,本基金管理人保留调整保 投资策略分资产配置策略、股 暨等。	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效,1、以确定的發生合在。即时间以高的效 時以,1、以确定的發生合果。 时代就是合果健增值的目的,无风险资产一般 要等双益差等。 在基金资产可放大倍数的管 新的基础上。根据它PD数理机制,历史根拟和目 义程完益出放大倍数的合理上限的建议,供基 设备资产配置的参考。 即货等新的金额付生产品且在开放式基金许可 本投资策略的权利。 罪投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股 罪投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股
理 前金 的投 指期	,基宏区 场里如资本货资基之的 等。 基础, 基础, 基础, 基础, 基础, 基础, 基础, 基础, 基础, 基础,	里人的金融上程小组化定量分 原用出具体本基金资产配置建筑 决策委员会和基金经理作为基 全存续期内市场出现股制 内,本基金管理人保留调整保 投资策略分资产配置策略、股; 態等。 置策略 产配置策略分为两个层水。	額略,它主要是通过数量分析、根据市场的波动 經數人,以國際投资组合在一般时间以高的效 成功。 成功。 成功。 成功。 成功。 成功。 成功。 成功。
理前金 的 指 以产	·基状人在范基安员、本定公司 基状人在范基投资基比所 基状投本国金资产金例产 基础的产品。	里,出出具保本理社企電於 決策委员会和基金签产配置對 決策委员会和基金经理作为指 均,本基金管理人保留開整保 投资策略分资产配置策略,股 置策略 置策略 方。在 宣策等的方两个层次;一 合保险策略分次两、因风险资 的收益。是一巴为以股份等本	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效,1、以确定的發生合在。即时间以高的效 時以,1、以确定的發生合果。 时代就是合果健增值的目的,无风险资产一般 要等双益差等。 在基金资产可放大倍数的管 新的基础上。根据它PD数理机制,历史根拟和目 义程完益出放大倍数的合理上限的建议,供基 设备资产配置的参考。 即货等新的金额付生产品且在开放式基金许可 本投资策略的权利。 罪投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股 罪投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股
理前金 的 指 以产两	·基状人在范基投资基比所含量。 基状人在范基投资基比所含量, 基础的, 基础的, 基础的, 基础的, 基础的, 基础的, 基础的, 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。	集別出具保本建立。 提出具保本基金资产配置對 決策委员会和基金经到作为基 企存缐期内市场出现如股制 均,本基金管理人保留调整保 整等。 完整。 完整。 完整。 完整。 完整。 完整。 完整。 完整	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效,1、Jamekg砂组合在一种时间以后的砂 線效,1、Jamekg砂组合在一种时间以后的砂 对投资组合保健增值的目的,无风险资产一般 要等双益基金产。在基金资产可放大倍数的管 新的基础上。根据CPP级理机制,历史根拟和目 义程完益出位大倍数的合理上限的建议,供基 设备资产配置的参考。 期货等新的金额付生产品且在开放式基金许可 太投资策略的权利。 罪投资策略。依券投资策略、权证投资策略和股 层为对风险资产和无风险资产的配置。该层次 "是为对风险资产和无风险资产的配置。该层次 "是分对风险资产和无风险资产的配置。该层次
理前金 的 指 以产两	·基状人在范基投资基比所次股金况投本围金资产金例产的票目定资基之的策配资组生策投资基比所次股票,	與人內空線上程小單化在電分 則出具條本是含资产配置數 決策委員会和基金等产的型數 內,本基金管理人的基金 投資。 與一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個一個一個 一個一個一個一個一個一個一個一個一個 一個	額縣,它主要是通过數量分析、根据市场的被动 總數人,以國除股份组合在一般时间以高的於 報力,以國來與行组合保值的目的,无风险资产一般 等等好益类资产。在基金资产可放人倍数的 等的基础上。根据它PP级理机制,历史模拟和目 投售。由此一般地介倍数的合组,以供基 期货等前的基础上,根据它PP级理机制,历史模拟和目 报告。第一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一
理前金 的 指 以产两 医	·基状人在范基投资基比所次股基网定况投本围金资产金例产的票金险官定资基之的策配资组生策投资基之的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的重金险的重要的重要的重要的重要的重要的	理人的宣傳! 基心知在定置分 則出具保本基金勞严配置的 決策委员会和基金勞严化實施 內,本基金管理人保留與歷保 投资策略分分严化置策略。 完整一次 完整一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 總數),以關時股份组合在一般时间以高的效 經數),以關時股份组合在《財份 時期间以高的公室产一般 實等政益整分。在基金资产可放人倍數的管 等的基础上。根据它PP级理机制,历史根拟和且 及程,给出私大倍數的合理上限的建议,供基 期货等新的金融管件生产品且在开放式基金许可 本投资策略的规制。 界投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股 是为对风险资产和无风险资产的配置,该层次 产配分所能变势的失超大不能超过无风险资 部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这 投资限额之下,发挥时机选择能力,控制股票市
理前金 的 指 以产两 医	·基状人在范基投资基比所次股基网定况投本围金资产金例产的票金险官定资基之的策配资组生策投资基之的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的重金险的重要的重要的重要的重要的重要的	理人的宣傳! 基心知在定置分 則出具保本基金勞严配置的 決策委员会和基金勞严化實施 內,本基金管理人保留與歷保 投资策略分分严化置策略。 完整一次 完整一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 總數),以關時股份组合在一般时间以高的效 經數),以關時股份组合在《財份 時期间以高的公室产一般 實等政益整分。在基金资产可放人倍數的管 等的基础上。根据它PP级理机制,历史根拟和且 及程,给出私大倍數的合理上限的建议,供基 期货等新的金融管件生产品且在开放式基金许可 本投资策略的规制。 界投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股 是为对风险资产和无风险资产的配置,该层次 产配分所能变势的失超大不能超过无风险资 部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这 投资限额之下,发挥时机选择能力,控制股票市
理前金 的 指 以产两 医	·基状人在范基投资基比所次股基网定况投本围金资产金例产的票金险官定资基之的策配资组生策投资基之的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的票金险的重金险的重要的重要的重要的重要的重要的	理人的宣傳! 基心知在定置分 則出具保本基金勞严配置的 決策委员会和基金勞严化實施 內,本基金管理人保留與歷保 投资策略分分严化置策略。 完整一次 完整一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是一次 是	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 總數),以關時股份组合在一般时间以高的效 經數),以關時股份组合在《財份 時期间以高的公室产一般 實等政益整分。在基金资产可放人倍數的管 等的基础上。根据它PP级理机制,历史根拟和且 及程,给出私大倍數的合理上限的建议,供基 期货等新的金融管件生产品且在开放式基金许可 本投资策略的规制。 界投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股 是为对风险资产和无风险资产的配置,该层次 产配分所能变势的失超大不能超过无风险资 部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这 投资限额之下,发挥时机选择能力,控制股票市
埋前金 的 指 以产两 场 为潜上市管 投 期 恒部个 下 主力	· 悉理如资本货1.本定分层2.本跌本要由金状人在范基投资基比所次股基风基原高官况投本围金资产金例产的票金险金则至5定资基之的策配资组生原投注,依非倾	型、的宣傳上程/公理/C重智/ 即出具信体表验/产配管型 决策/线用内市场出现。加起对 力、基金管理/加速/ 形成 大型	館略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線別,以屬地區的報告在一時中间以高的效 成別,以屬地區的報告在一時中间以高的 時期,以屬地區的報告在一時,天风险资产一般 等內域是大學。在基金资产可放大值數的 對於等新的金融性,是由且在开放式基金许可 成之。在一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個
埋前金 的 指 以产两 场 为潜名上市管 投 期 恒部个 下 主力耳	·基状人在范基投资基比所次股基风基原高合金官定资基之代本的基投资基比所次股基风基原高合金官定定资基之的实施基础金则至11年,2000年,200	型、的宣傳上程少至任定置分 即出具保本社会所不配置的 於東東與所有基金型。但如 於東東與所有基金型。但 如 功。本基金管理。 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線別,以過數性的報告在一點时间以后的始 線別,以過數性的報告在一點的間以的 時期,以應數性的報告在一點。 是一一 是一一 是一一 是一一 是一一 是一 是一 是一 是
埋前金 的 指 以产两 场 为潜名,保上市管,投,期,恒部个,下,主力耶,证	·基状人在范基投资基比所次股基以基原本投入在范基投资基比所次股基风基原高综基合资化,以基原高综基合的官定资量之的实施资产金例产的票金险金则至自然基合的原配资组生策投注,依末假毕通的	型、的宣傳上程少至任定置分 即出具保本社会所不配置的 於東東與所有基金型。但如 於東東與所有基金型。但 如 功。本基金管理。 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	館略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線別,以屬地區的報告在一時中间以高的效 成別,以屬地區的報告在一時中间以高的 時期,以屬地區的報告在一時,天风险资产一般 等內域是大學。在基金资产可放大值數的 對於等新的金融性,是由且在开放式基金许可 成之。在一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個
埋前金 的 指 以产两 场 为潜名 保风上市管 投 期 恒部个 下 主力,再 证险	·基场里如资本货1、本定分32.7本铁本要由经本组。基状人在范基投资基比所次股基风基原高分基合变况投本国金资产金例产的票金险金则至捐金的官定资基之的策配资组生策投注,依求假料通收	即、則立國性。其外項任定置分 則出具條本格為一般的學 於漢象與所為的基金與所的功 功 功 功 功 功 以 之 等 的 等 等 是 等 等 是 等 等 是 等 等 是 等 等 是 等 等 是 等 是 等 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 等 是 是 等 是 是 等 是 是 等 是 是 等 是 是 等 是 是 等 是 是 等 是 是 等 是 是 等 的 要 成 長 長 表 所 是 是 。 等 的 要 。 之 方 成 是 是 。 之 所 之 是 之 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效,1、以确定股份组合在一种时间以后的效 域),以确定股份组合保护时间以后的设 时投资组合保健增值的目的,无风险资产一般 要等以起类学。在基金资产可放大倍数的管 折的基础上。根据CPP级理机制,历史根拟和目 又程率。给出处大倍数的合理上限的建议,供基 理论等新的金融付生产品且在开放式基金许可 成投资策略的发利。 果投资策略、债券投资策略、权证投资策略和股 层为对风险资产和无风险资产的配置该层次 "强分所能置策略。基金管理人将根据情况对这 处资限额之下,发挥时机选择能力,控制股票市 以低风险性,在保本期限内具备中期上涨潜力 均宽度进行。首先按照风险性由低至高,中期上涨潜力 均宽度进行并名,累加二则非上涨潜力的股票, 行行组合投资。 6和流动性管理,降低个股集中性风险和流动性
埋前金 的 指 以产两 场 为潜名 保风上市管 投 期 恒部个 下 主力,再 证险	·基场里如资本货1、本定分景2、本铁本要由货本组。3、本基状人在范基投资基比所次股基风基原高宗基合 债基证况投本围金资产金例产的票金险金则至月金的 券金官定资基之的策配资组生策投注,依未假;通收 投的	即人的宣傳上程少致在定置分 即出具係本學所是的學術學 決策委員会和高金空期代別 持一次 力學的學術學 中國學術學 中國學術學 中國學術學 中國學術學 一個學 一個學 一個學 一個學 一個學 一個學 一個學 一個	館縣,它主要是通过數量分析、根据市场的被动 總數人以動除投稅省合在一般时间以高的效 確數人以動除投稅省合在一般时间以高的资产一般 實幹好益类勞产。在基金资产可放大倍数的分 股份,在一般,在一般,在一般,在 股份,在 股份,在 股份,在 股份,在 股份,在 股份, 股份, 股份, 股份, 股份, 股份, 股份, 股份, 股份, 股份,
埋前金 的 指 以产两 场 为潜名,保风上市管 投 期 恒部个 下 主力耳,证险	·基状人在范基投资基比所实股基风基期高分本/显状人在范基投资基比所实股基风基期高分基合 债基公况投本围金资产金例产的票金险金则至月金的 券金姓官定资基之的策配资组生策投注,依述佩料通收 投的存	理人的宣傳上報小班在定置分 則出具條本整例会和基金勞研性方 法東委员会和基金勞研性方 技術。 投資報節分配量與的是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	額略,它主要是通过數量分析、根据市场的波动 線效)、以确性的發生合在一般时间以后的珍 線)、以确性的發生合係。 經數之一個 時期, 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個
埋前金 的 指 以产两 场 为潜名,保风上市管 投 期 恒部个 下 主力耳,证险	·基状人在范基投资基比所实股基风基期高分本/显状人在范基投资基比所实股基风基期高分基合 债基公况投本围金资产金例产的票金险金则至月金的 券金姓官定资基之的策配资组生策投注,依述佩料通收 投的存	理人的宣傳上報小班在定置分 則出具條本整例会和基金勞研性方 法東委员会和基金勞研性方 技術。 投資報節分配量與的是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	額略,它主要是通过數量分析、根据市场的波动 線效)、以确性的發生合在一般时间以后的珍 線)、以确性的發生合係。 經數之一個 時期, 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個
埋前金 的 指 以产两 场 为潜名,保风上市管 投 期 恒部个 下 主力耳,证险	·基状人在范基投资基比所实股基风基期高分本/显状人在范基投资基比所实股基风基期高分基合 债基公况投本围金资产金例产的票金险金则至月金的 券金姓官定资基之的策配资组生策投注,依述佩料通收 投的存	理人的宣傳上報小班在定置分 則出具條本整例会和基金勞研性方 法東委员会和基金勞研性方 技術。 投資報節分配量與的是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	額略,它主要是通过數量分析、根据市场的波动 線效)、以确性的發生合在一般时间以后的珍 線)、以确性的發生合係。 經數之一個 時期, 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個
埋前金 的 指 以产两 场 为潜名,保风上市管 投 期 恒部个 下 主力耳,证险	·基状人在范基投资基比所实股基风基期高分本/显状人在范基投资基比所实股基风基期高分基合 债基公况投本围金资产金例产的票金险金则至月金的 券金姓官定资基之的策配资组生策投注,依述佩料通收 投的存	理人的宣傳上報小班在定置分 則出具條本整例会和基金勞研性方 法東委员会和基金勞研性方 技術。 投資報節分配量與的是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	額略,它主要是通过數量分析、根据市场的波动 線效)、以确性的發生合在一般时间以后的珍 線)、以确性的發生合係。 經數之一個 時期, 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個
理前金的指,以产两场,为潜名,保风有合。 债根用工作管 "投"期,"恒部个"下,主力"再",证险。 到收、金据红	"基场里如资本货工本定分尝入本铁本要由货本租。3、本(期益、2、融利年基状人在范基投资基比所次股基风基原高宗基合 债基)原的6.2、融率原官完资基之的货配资租全税分的票金险金则至有金的 券金持则稳综,预租	型、的宣傳上程少致任定置分 即出具保奈和高差型如何的 於漢彙與原於和高差型如何的 於漢文與原於,但是一個 如,本基合管則,但留圖發展 投資和點分資产配置策略,設 避實施 對於一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效)、以确性的强合企一的时间以后的冷 線)、以确性的强合企一的时间以后的冷 等)、以确性的强力。 是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个
理前金的指,以产两场,为潜名,保风有合。 债根用工作管 "投"期,"恒部个"下,主力"再",证险。 到收、金据红	"基场里如资本货工本定分尝入本铁本要由货本租。3、本(期益、2、融利年基状人在范基投资基比所次股基风基原高宗基合 债基)原的,2、融率原官完资基之的贷配资租生策投注,依,假料通收 投的有"定合信澳顶租	型、的宣傳上程少致任定置分 即出具保奈和高差型如何的 於漢彙與原於和高差型如何的 於漢文與原於,但是一個 如,本基合管則,但留圖發展 投資和點分資产配置策略,設 避實施 對於一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是一個 是	額略,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效)、以确性的强合企一的时间以后的冷 線)、以确性的强合企一的时间以后的冷 等)、以确性的强力。 是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个
理前金 的 指一以产两 场,为潜名,保风 有合,债根用提上市管,投,期,恒部个,下,主力非,证险。 到收,金据杠高	"基场型如资本货1、本定分层2、本跌本要由货本组。3、本(期益(温利干路)、量软人在范基投资基比所次股基风基原高综基合(债基)原的)债率原体),资金转则稳综,预理组利,更完全,是一个企业,以下企会,通过 化洋低计通收 投的有"定会告询以合计"	型、的宣應性。其外項任定置分 排出具條本於一般之對 於漢文與一般的一般之一。 於其一數一般。 如一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一般, 如一一一一。 如一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一	館縣,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效,1、以商收货效金合在一种时间以高的效 線),以商收货效金合保值增值的目的,无风险资产一般 度效。大量的成功。 一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是
理前金 的 掮 以产两 场,为潜名,保风 有合,债根用提,申上市管,投,期,恒部个,下,主力14,证险。 到收,金据扛高,购	基础人工企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业	理、助空應性、基於小班代定置分計 供養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養	館縣,它主要是通过數量分析、報期市场的波动 總效,1、國際股份组合在一般时间以高的效 經數,1、國際股份组合在一般时间以高的资产一般 經數人以關係股份组合在一般时间以高的资产一般 經數人 與一個人 與一個人 與一個人 與一個人 一個人 一個人 一個人 一個
理前金 的 掮 以产两 场,为潜名,保风 有合,债根用提,申上市管,投,期,恒部个,下,主力14,证险。 到收,金据扛高,购	基场业如资本族儿本定分景之本类本要由资本组。3本年间翻绕2融平版经常经常经常在现在,在一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	理、助空應性、基於小班代定置分計 供養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養養	館縣,它主要是通过數量分析,根据市场的波动 線效,1、以商收货效金合在一种时间以高的效 線),以商收货效金合保值增值的目的,无风险资产一般 度效。大量的成功。 一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是

中與利此時,以次中級宗 (4)利用未來可能性的利率定期,利率期货、利率期权等金融衍生工具,有效地规避 利率风息 投入。 利率风息 大型。在北持行权证投资制等 本基合产出行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型 寻求其合理估值水少,并积极利用正规权权证之间的不同组合来靠取无风险收益。 本公司等允分等股政资产的收益性、流动性及风险性特征、通过资产配置、品种与美 區选择、落帧进行投资。追求较稳定的当期收益 5、股指则投投资资金。 如在本基金存获期内市场出现如股份销售销货等新的金融衍生产品且在开放式基金许可 的投资范围之内。本基金将根据风险管理的原则,以复辩保值为主要目的,有选择地投资于 股捐期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

选择	*,谨慎 九、書		分考虑股	理的信 指期的	5佰水平。			运行趋势的研究。 E,通过资产配置、
		管理人将充进行投资,以 金的业绩比	降低投资 较基准	组合的	的整体风险。			Tyrus and Training
	十、基	金的风险收益	語:3年期 許征	1121丁八	三月月十千宗人为心)			
	本基金	为保本基金 基金的投资4	,属于证券	投资	基金中的低	风险品种。		
1000.000	基金管	管理人的董事	会及董事	保证本	x报告所载?	8料不存在5	世假记	载、误导性陈述或
遗漏	1, 井对 基金打	其内容的真③ E管人中国工	K性、准确 商银行股	性和兒 份有問	と整性承担ないできます。 はいますが、これでは、これでは、これでは、これでは、これでは、これでは、これでは、これでは	下别及连带式 k基金合同期	5任。 见定,怎	夏核了本报告中的 载、误导性陈述或
		表现和投资约	且合报告等	內容	,保证复核	内容不存在原	世假记:	载、误导性陈述或
大遗	基金管	き理人承诺以	城实信用	、勤勉	尽责的原则	管理和运用	月基金	资产,但不保证基
定品		上山結并不代	表其未來	実班.	松密有风图	☆ 投资者在	作出权	b资决策前应仔细
本基	金的拍	9募说明书。						CDCDCDCH112211
		组合报告所报告期末基金			4年3月31日	1(木没申订) 。	
	序号	項			金额(t)	占基金	总资产的比例(%)
	1	权益投资				47,435,813.61		11.84
	2	其中:股票 固定收益投资				47,435,813.61		11.84
	2	固定収益投資 盆中,债券		-		41,889,286.10 41,889,286.10		73.81
	\vdash	资产支持证券		_	1,5	+1,009,200.10		73.61
	3	贵金属投资				-		
	4	金融衍生品投	资					
	5	买人返售金融		Т	1	60,000,000.00		7.66
		其中:买断式目 售金融资产	国购的买人注	医		-		-
	6	银行存款和结	算备付金合		1	08,945,403,45		5.22
	-	计 其他资产		-		, ,		1.47
	(=)	共電景/F 报告期末按符	f业分类的	別股票		30,776,623.03		1.47
	代码		L类别	272.274		个值(元)	占基	金资产净值比例(%)
	Α	农、林、牧、渔业	k			2,899,697.8	8	0.14
	В	采矿业					-	_
	С	制造业	Are TR. July 18. 180	See 111.		82,450,779.6	.0	3.98
	D	电力、热力、燃气及水生产和(应业				26,565,328.3	5	1.28
	E	建筑业					-	_
	F	批发和零售业				1,925,196.0	-	0.09
	G	交通运输、仓息	者和邮政业			107,110,840.7	6	5.16
	Н		化新砂 自 抽 :	ir iig			_	
	I	信息传输、软件 务业	F 114 IEI AD 1X.2	IN THE		8,522,126.0	10	0.41
	J	金融业				377,729.9	_	0.02
	K L	房地产业 租赁和商务服	Az .II.			3,909,024.0	10	0.19
	M	私页和阿芬取 科学研究和技					_	
	N	水利、环境和	公共设施管	理业		13,675,091.1	0	0.66
	0	居民服务、修	理和其他服	务业			-	_
	P		投 育				-	_
	Q	卫生和社会工作					-	_
	R.	文化、体育和娱乐业 综合 合计					_	_
	S					247,435,813.6	- 1	11.93
	(E)	报告期末按约		基金	资产净值比			-名股票投资明细
	序号	股票代码	股票名称		対量(股)	公允价值(占基金资产净值比 例(%)
	1	601006	大秦铁路		16,034,557	107,110	,840.76	5.16
	2	601179	中国西电		6,227,103		,365.22	1.12
	3	600703	三安光电		909,423	20,689	,373.25	1.00
	4	600578	京能电力		5,678,055		,217.45	0.98
	5	600406	国电南瑞		603,550		,126.00	0.41
	7	600519 000521	贵州茅台		46,348 1.172.200		,035.60	0.35
	7 8	600749	美変电器 西藏旅游		1,172,200		,868.00	0.34
	9	600863	内蒙华电		1,741,158	0,070	,110.90	0.30
	10	601299	中国北车		1,130,100		,664.00	0.25
	(四)	报告期末按值	贵券品种分	类的	债券投资组			
	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		+		_		
		央行票据		+		-		_
	2			1	11	9,844,000.00		5.78
	2	金融债券		-	119,844,000.00 119,844,000.00			5.78
	-	金融债券 其中:政策性	金融债		11	9,844,000.00		3.70
	-		金融债			9,317,286.10		3.34
	3	其中:政策性			6			
	3 4 5 6	其中:政策性 企业债券 企业短期融) 中期票据			6	9,317,286.10		3.34
	4 5	其中:政策性 企业债券 企业短期融) 中期票据 可转债			6	9,317,286.10 0,997,000.00		3.34 18.37
	3 4 5 6	其中:政策性 企业债券 企业短期融) 中期票据			6	9,317,286.10 0,997,000.00		3.34 18.37

3、其他资产构成

二)扫	报告期末按征	宁业分类的	別股票	投资组合				(4
七码		业类别			介值(元)	占基	金资产净值比例(%)	(5
Α	农、林、牧、渔	lk			2,899,697.8	88	0.14	(7
В	采矿业					-	-	(8
С	制造业				82,450,779.6	60	3.98	2,基
D	电力、热力、燃 应业	电力、热力、燃气及水生产和(b 应业		26,565,328.35			1.28	(1 的计算方
E	建筑业					-	-	H= HX
F	批发和零售业	4			1,925,196.0	00	0.09	E为基础
G	交通运输、仓				107,110,840.7	76	5.16	是会 管理费戈
Н	住宿和餐饮业					-	_	人。若退
I	信息传输、软 务业	件和信息技2	ド服	8,522,126.00			0.41	保2
J	金融业				377,729.9)2	0.02	本基 H=
K	房地产业			3,909,024.00			0.19	HУ
L	租赁和商务朋			-			_	E大
M	科学研究和技			-			-	托管费划 假日、公
N	水利、环境和			13,675,091.10			0.66	E
O P	居民服务、修	: 埋和其他服 教育	务业			_	_	出金額列 3、7
		取 ED D社会工作						下多
Q R		育和娱乐业				_		失; (1
S		综合				_	_	(2
		合计		247,435,8		i1	11.93	(3 费用;
Ξ.)∄			i基金	资产净值比			一名股票投资明细	(4
手号	股票代码	股票名称	1	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比 例(%)	4、 5 基: 率、基金
1	601006	大秦铁路		16,034,557	107,110	,840.76	5.16	调配
2	601179	中国西电		6,227,103	23,289,365.22		1.12	调低基金基金
3	600703	三安光电		909,423	20,689,373.25		1.00	(=
4	600578	京能电力		5,678,055	20,384,217.45		0.98	1、月本主
5	600406	国电南瑞		603,550		,126.00	0.41	递减,如
6	600519	贵州茅台		46,348		,035.60	0.35	
7	000521 600749	美菱电器 西藏旅游		1,172,200 677,080		,868.00	0.34	L
9	600863	内蒙华电		1,741,158		,110.90	0.31	
10	601299	中国北车		1,130,100		,664.00	0.25	_
	设告期末按		类的			,004.00	0.23	*J
序号		品种		公允价值		占基	金资产净值比例 (%)	册登记等 本基
1	国家债券				-		_	净申申申
2	央行票据				_		_	申與
3	金融债券			11	9,844,000.00		5.78	2.质
	其中:政策性	生金融债 119,844,000.00			5.78	为365天		
4	企业债券			6	69,317,286.10		3.34	
5	企业短期融	资券		38	0,997,000.00		18.37	
6	中期票据			97	1,731,000.00		46.85	
7	可转债				-		_	投资
8	其他				-		_	时收取, 的比例不
9	合计				1,889,286.10		74.34	赎回
五) 字号	报告期末按 债券代码	公允价值 债券名		金资产净值b 数量(张)	と例大小排4 公允价值(五名债券投资明纸 占基金资产净值比	型 赎证 赎证 净帳
							例(%)	3,7
2	130243	13国开43 11沪国盛M	TND	1,200,000	119,844 100,980		5.78 4.87	管理人口 费方式区
3	1182111	11年四級M		1,000,000	100,980		4.87	4.i
3	1102130	- m m.	1101	1,000,000	100,880	,000.00	4.86	金促销计

6 其他应 7 待维费		-				-
8 其他						
注:本基金本报 5、报告期末前 注:本基金报告 十二、基金的业		转股期的可 通受限情况 股票流通受	顶转换债券。 的说明 必限情况。			776,623.0.
基金管理人依明 定盈利,也不保证最 央策前应仔细阅读本	k基金的招募说明 ‡	主业绩并不 片。	代表其未来	表现。投资有	金質产,這风险,投资	3不保证 资者在做
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
2008.11.12~200		0.13%	0.52%	0.01%	1.28%	0.12%
2010.1.1~2010.1		0.95%	3.31%	0.01%	8.97%	0.94%
2011.1.1~2011.1		0.79%	4.11%	0.01%	-12.08%	0.78%
2012.1.1~2012.1		0.23%	4.60%	0.01%	-1.80%	0.22%
2013.1.1~2013.1		0.23%	4.05% 0.96%	0.01%	-1.71% 0.78%	0.22%
自基金成立至《	ŷ	0.65%	22.72%	0.01%	5.05%	0.64%
本基金级上海(2.基金级用+1/10 2.基金级用+1/10 (1)基金管1-1-1 H=E×12/8-1 H=E×12/8-1 H=E×12/8-1 H=E×12/8-1 H=E×12/8-1 G(A)基金的对信号 (2.1基金的对信号 H=E×12/8-1	行之则使用, 与关规定和,基金在使 原制所发生费用,被工业费用。 是有一个人。 是一个人。 是一个人。 是一个一个人。 是一个一个人。 是一个一个人。 是一个一个人。 是一个一个人。 是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	突际支出格 技付方式 技付方式 持管理教按 毎月月末、 一年 毎月月末、 一年 一年 一年 一年 一年 一年 一年 一年 一年 一年	以基金财 前一日基金 按月支付, 下工作日内, 工作日内, 按月支付, 下工作日内, 按月支付, 下工作日内, 根据有分 支付, 下支付。 下支付。 下支付。 下支付。 下支付。 下支付。 下工作日内, 下工作日内, 下工作日内, 下工作日内, 下工作日内, 下工作日内, 下工作日内, 下工作日内, 下工作日内, 下工作日内, 下工工作日内, 下工工作日内, 下工工作日内, 下工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工	○ 总值中订验 於资产单值的 由基金管理/ 中 山場 上 長 上 長 上 長 上 長 上 長 上 長 上 長 上 長 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上 上	。。3%年费8 。3%年费8 。向基金打一次性3 的计算方 。向基金打一次性支其 协议规定	率计提。 任管人发起 法如下 任管、表现下 任管、若进 大发动,按费用 发基金勋
费用;	人和基金托管人处理 1》生效前的相关费 目关法律法规及中国					
4、费用调整						
周低基金管理费率、 基金管理人必约 (二)与基金销 1、申购费 本基金申购费	费率、基金托管费率	过基金销售费率 金销售费率 实施日前2日	与费率等费 等费率,无 日在至少一	率,须召开基 须召开基金份 家指定报刊和	金份额持分额持有人	有人大: (大会。 。
递减,如下表所示 :	购买金额(M)			自购费率		
	州大亚朝(M) M<100万	_		1.2%		
10	00万 ≤M<500万			0.8%		
50	0万≤M<1000万			0.4%		
册登记等各项费用。 本基金的申购的 净申购金额 = 申购费用 = 申 申购份额 = 净 2、赎回费	M≥1000万 费用由基金申购人对 金额包括申购费用利 申购金额/(1+申吸购金额 - 净申购金 申购金额/申购当日 未持有到期,赎回费	和争申购金 好费率) :额 日基金份额	额。其中, 争值		基金的市场	
为365天,15年为547	7天)。具体如下表	所示:	4U70 , PULL H- H	門刀物可"日4:	HPB/HILL]]2 <u>12</u> (\$43, \ ;
申请	份额持有时间(N)			赎回费率		
	N<1.5年 1.5年 ≤N<3年			2.0%		
当期保本期内, 投资者可将其材 材收取,扣除用于市 的比例不得低于259 贼回金额的计划 贼回党—— 贼回费—— 贩回费—— 海取回金额—则	,持有到期,城间既当 持有的全部或部分。 场推广、注册登记等 6。 第公式为: 数回份额喊回当日基 如总金额喊回费率 和总金额喊回费率	基金份额赎 费和其他手 基金份额争的	续费后的分 值	的赎回费用在 令例日基金财	产,赎回装	初日人基
管理人可以根据《基 费方式实施日前2个 4、基金管理人司 金促销计划、针对特	可以在不违背法律法	定调整费率 指定报刊和 去规规定及	域收费方式 网站公告。 《基金合同 初价投资:	式,基金管理/ 》约定的情形 	、最迟应于 《下根据》	F新的费 5场情况 (如网

容如下: 1.在"基金管理人"部分,更新了主要人员情况。 2.在"基金托管人"部分,对基金托管人的"主要人员情况"、"基金托管业务经营情况"及" 基金托管人的内部投票制度"进行了更新。 3.在"柱法服务机构"和分,对代销银行、代销券商和其他代销机构名单及会计师事务所的办

南方基金管理有限公司 二〇一四年六月十七日

(二)具配货用 本基金其他费用根据相关法律法规执行。 十四、对招募说明书更新部分的说明 木其全管理人体程/(中代人) 已 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。 (七)报告期末投公元价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股金属投资明细 注:本基金本报告期末未持有报金属。 (八)报告期末投公元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。 (九)报告期末本基金处贸的股贴期货持合和损益明细 注:本基金本报告期内未投资股贴制度资金制充说明 注:本基金本报告期内未投资股制的股公规制度。 (十)报告期末本基金投资的国制用货交易情况说明 注:本基金本报告期内未投资取借制货。 (十一)报资组合银产品产品。 (十一)报资组合银产品产品。 (十一)报资组合银产品。 (十一)报资组合银产品。 (十一)报资组合银产品。 (十一)报资组合银产品。 (十一)报资组合银产品。 (十一)报资组合银产品。 (十一)报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 制口前一年内交到公开通点,处罚的证券。 票。