# 南方宝元债券型基金 2009年半年度报告摘要

2009年06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**
**送出日期:2009年08月25日**

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2009年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至6月30日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 南方宝元债券 |
| 交易代码 | 202101 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2002年09月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,298,894,705.54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“南方宝元”。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为开放式债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅,在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下,确保基金安全及追求资产长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 南方宝元债券型基金采取自上而下的投资策略,通过对宏观经济形势以及财政货币政策的深入分析,确定资产配置的指导原则,在此基础上依照收益率与风险特征对不同金融产品的投资比例进行合理配置,并随投资环境的变化及时做出调整。力争在控制利率风险与市场风险的同时,为投资者获取稳定收益。 |
| 业绩比较基准 | 南方宝元债券型基金采用 75%×交易所国债指数+25%×(上证A股指数+深证A股指数)”为业绩比较基准。 |
| 风险收益特征 | 南方宝元债券型基金属于证券投资基金中的低风险品种,其风险收益配比关系为低风险、适度收益。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 南方基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 鲍文革 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 95588 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.nffund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公地址 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2009年1月1日-2009年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 140,632,680.13 |
| 本期利润 | 321,449,382.65 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1523 |
| 本期基金份额净值增长率 | 15.35% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2009年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0306 |
| 期末基金资产净值 | 2,615,262,914.36 |
| 期末基金份额净值 | 1.1376 |

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.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.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

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 5.43% | 0.40% | 2.44% | 0.25% | 2.99% | 0.15% |
| 过去三个月 | 7.58% | 0.45% | 5.83% | 0.35% | 1.75% | 0.10% |
| 过去六个月 | 15.35% | 0.52% | 12.46% | 0.44% | 2.89% | 0.08% |
| 过去一年 | 9.09% | 0.61% | 11.44% | 0.58% | -2.35% | 0.03% |
| 过去三年 | 96.84% | 0.75% | 31.93% | 0.58% | 64.91% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 175.13% | 0.57% | 41.34% | 0.47% | 133.79% | 0.10% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券股份有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市机场(集团)有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

截至报告期末,公司管理资产规模达1,800多亿元,管理2只封闭式基金——基金开元、基金天元;16只开放式基金——南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金、南方高增长基金、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方金球精选配置基金(QDII基金)、南方盛元红利股票型基金、南方优选价值股票型基金、南方恒元保本混合型证券投资基金和南方沪深300指数证券投资基金;以及多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 高峰 | 本基金的基金经理 | 2008年01月14日 | - | 7 | 理学博士,具有基金从业资格。曾任职于上海大学理学院、美国SAS软件研究所上海公司,2002年加入南方基金,2006年3月至今,任南方多利基金经理;2008年1月至今,任南方宝元基金经理。 |
| 蒋朋宸 | 本基金的基金经理 | 2009年02月10日 | - | 5 | 生物化学硕士、金融工程学硕士,具有基金从业资格。曾担任鹏华基金公司基金管理部分析师,2005年加入南方基金,2008年4月至今,任南方盛元基金经理;2008年4月至今,任南方隆元基金经理。2009年2月至今,任南方宝元基金经理。 |
| 蒋峰 | 本基金的基金经理 | 2008年1月14日 | 2009年2月10日 | 8 | 经济学博士,具有基金从业资格。曾任职于鹏华基金公司和宝盈基金公司,2003年11月至2006年11月,担任宝盈鸿阳证券投资基金经理。2007年加入南方基金,2007年6月至今,任南方避险基金经理;2008年1月至2009年2月,任南方宝元基金基金经理;2008年11月至今,任南方恒元基金经理。 |
| 应帅 | 本基金的基金经理 | 2007年5月10日 | 2009年2月10日 | 8 | 管理学硕士,具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员,2007年加入南方基金管理,2007年5月至2009年2月,任南方宝元基金经理;2007年5月至今,任南方成份基金经理。 |

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

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《中人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方宝元债券型基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人没有管理与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

经济复苏是今年以来宏观经济研究的主题。信贷大幅度增加,股票市场迅速反弹,债券市场出现回落,反映了投资者对经济复苏信心,以及对未来通货膨胀的担心。

今年以来,本基金主动调整了债券仓位,卖出部分长期金融债长债,增持了部分收益较高的中短期企业债,降低利率风险,以期获得较高的持有期收益。

2009年上半年,南方宝元债券型基金净值增长率15.35%,同期业绩基准的增长率为12.46%。超越业绩基准2.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下一阶段债券投资我们以稳健为主,在市场波动中寻找相对高收益率的品种,充分保证组合的流动性,在适当的时机,合理调整组合的久期和结构,力争获得债券市场的稳定收益。

上半年,股票市场出现了较大幅度的上升,这一方面反映了经济形势的回升,另一方面也包含了投资者对未来预期的转变。虽然基金管理组对于经济的回升仍表示谨慎,但股票部分投资风格方面比较积极,其主要原因是较好把握了高额信贷下资产价格上涨的趋势。我们认为世界将承受较长时期的经济低增长,但中国经济在强有效的政策刺激下,将率先走出低迷。我们认为下半年股票市场将在震荡中上行。基金管理组仍将坚持对个股的深入研究,寻找在经济恢复过程中业绩超越预期或者有长期增长能力的公司与个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、风控策略总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制订的相关制度,负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,本基金的收益分配原则为:基金收益分配比例按有关规定制定;投资者可以选择现金分红方式或分红再投资的分红方式,以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准,投资者选择分红的默认方式为现金分红;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当期收益应先弥补上期亏损后,才可进行当期收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次,但若成立不满3个月则不进行收益分配,年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成;基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值;每一基金单位享有同等分配权。

根据上述分配原则,本报告期内本基金无需收益分配。

## §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2009年上半年,本基金托管人在对南方宝元债券型基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009年上半年,南方宝元债券型基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方宝元债券型基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,南方宝元债券型基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方宝元债券型基金2009年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2009年8月21日

## §6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方宝元债券型基金

报告截止日:2009年06月30日

金额单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2009年6月30日 | 上年度末 2008年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 89,249,030.69 | 2,862,396.43 |
| 结算备付金 | | 2,395,064.40 | 941,475.79 |
| 存出保证金 | | 710,197.68 | 704,852.28 |
| 交易性金融资产 | | 2,539,372,625.51 | 2,106,499,853.92 |
| 其中:股票投资 | | 850,697,705.21 | 345,146,495.12 |
| 债券投资 | | 1,688,674,920.30 | 1,761,353,358.80 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 19,826,511.99 |
| 应收利息 | | 33,656,023.11 | 19,340,969.34 |
| 应收股利 | | 414,315.00 | - |
| 应收申购款 | | 21,032,401.35 | 2,053,953.30 |
| 其他资产 | | 185,000.00 | 75,000.00 |
| 资产总计 | | 2,687,014,657.74 | 2,152,305,013.05 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2009年6月30日 | 上年度末 2008年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 49,999,805.00 | 211,999,530.00 |
| 应付证券清算款 | | 10,285,901.76 | 18,705,762.74 |
| 应付赎回款 | | 7,609,260.13 | 1,565,592.17 |
| 应付管理人报酬 | 6.4.4.2.1 | 1,569,304.55 | 1,221,916.58 |
| 应付托管费 | 6.4.4.2.2 | 366,171.07 | 285,113.87 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 688,086.41 | 679,676.10 |
| 应交税费 | | 256,858.10 | 256,858.10 |
| 应付利息 | | 9,454.80 | 5,866.43 |
| 应付利润 | | - | - |
| 其他负债 | | 966,901.56 | 840,113.93 |
| 负债合计 | | 71,751,743.38 | 235,560,429.92 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 2,298,894,705.54 | 1,943,515,686.73 |
| 未分配利润 | | 316,368,208.82 | -26,771,103.60 |
| 所有者权益合计 | | 2,615,262,914.36 | 1,916,744,583.13 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,687,014,657.74 | 2,152,305,013.05 |

注:1、报告截止日2009年6月30日,基金份额净值1.1376元,基金份额总额2,298,894,705.54份。

2、后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:南方宝元债券型基金

本报告期:2009年01月01日至2009年06月30日

金额单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期金额 2009年1月1日至2009年6月30日 | 上年度可比期间金额 2008年1月1日至2008年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 335,112,033.52 | -313,785,056.78 |
| 1.利息收入 | | 30,726,727.15 | 32,266,605.29 |
| 其中:存款利息收入 | | 206,202.59 | 2,256,219.66 |
| 债券利息收入 | | 30,520,524.56 | 30,010,385.63 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 122,896,800.63 | -14,666,292.80 |
| 其中:股票投资收益 | | 116,083,669.83 | -28,322,667.64 |
| 债券投资收益 | | 1,834,972.99 | 1,986,419.26 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | 9,242,305.20 |
| 股利收益 | | 4,978,157.81 | 2,427,650.38 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | 180,816,702.52 | -332,433,795.66 |
| 4.其他收入(损失以“-”号填列) | | 671,803.22 | 1,048,426.39 |
| 二、费用 | | -13,662,650.87 | -27,790,893.42 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.4.2.1 | -8,252,232.48 | -10,067,998.47 |
| 2.托管费 | 6.4.4.2.2 | -1,925,520.93 | -2,349,199.59 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | | -2,655,579.06 | -8,562,410.95 |
| 5.利息支出 | | -613,075.46 | -6,596,911.37 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | -613,075.46 | -6,596,911.37 |
| 6.其他费用 | | -216,242.94 | -214,373.04 |
| 三、利润总额 | | 321,449,382.65 | -341,575,950.20 |
| 四、净利润 | | 321,449,382.65 | -341,575,950.20 |

后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方宝元债券型基金

本报告期:2009年01月01日至2009年06月30日

金额单位:人民币元

| 项目 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,943,515,686.73 | -26,771,103.60 | 1,916,744,583.13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 321,449,382.65 | 321,449,382.65 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 355,379,018.81 | 21,689,929.77 | 377,068,948.58 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,057,013,711.10 | 69,090,659.30 | 1,126,104,370.40 |
| 2.基金赎回款(以“-”号填列) | -701,634,692.29 | -47,400,729.53 | -749,035,421.82 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,298,894,705.54 | 316,368,208.82 | 2,615,262,914.36 |
| 项目 | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 2,320,428,652.73 | 549,207,010.48 | 2,869,635,663.21 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -341,575,950.20 | -341,575,950.20 |
| | | | |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 19,739,631.41 | 6,366,322.88 | 26,105,954.29 |
| 其中:1.基金申购款 | 778,596,679.81 | 144,141,244.01 | 922,737,923.82 |
| 2.基金赎回款(以“-”号填列) | -758,857,048.40 | -137,774,921.13 | -896,631,969.53 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,340,168,284.14 | 100,196,607.60 | 2,440,364,891.74 |

后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 南方基金管理有限公司(简为基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(中国工商银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 华泰证券股份有限公司(华泰证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 兴业证券股份有限公司(兴业证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 联合证券有限责任公司(联合证券”) | 基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金代销机构 |

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 204,235,739.90 | 11.39% | 1,570,347,673.06 | 56.21% |
| 联合证券 | 512,688,407.90 | 28.60% | - | - |

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 18,900,308.02 | 19.97% | 156,125,293.70 | 77.92% |
| 联合证券 | 24,690,163.99 | 26.09% | - | - |

6.4.4.1.3 债券回购交易

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 30,000,000.00 | 3.06% | - | - |
| 联合证券 | 180,000,000.00 | 18.37% | - | - |

6.4.4.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华泰证券 | - | - | 4,539,919.77 | 17.88% |
| 联合证券 | - | - | - | - |

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华泰证券 | 169,194.71 | 11.24% | 149,108.63 | 21.78% |
| 联合证券 | 435,779.95 | 28.96% | 107,020.61 | 15.63% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华泰证券 | 1,331,690.99 | 56.56% | 1,149,177.44 | 74.08% |
| 联合证券 | 107,020.61 | 15.63% | - | - |

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

金额单位:人民币元

| 项目 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期应支付的管理费 | 8,252,232.48 | 10,067,998.47 |
| 其中:当期已支付 | 6,682,927.93 | 8,496,426.11 |
| 期末未支付 | 1,569,304.55 | 1,571,572.36 |

支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.75%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

金额单位:人民币元

| 项目 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期应支付的托管费 | 1,925,520.93 | 2,349,199.59 |
| 其中:当期已支付 | 1,559,349.86 | 1,982,499.37 |
| 期末未支付 | 366,171.07 | 366,700.22 |

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.175%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.175%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

金额单位:人民币元

| 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | | | | | 99,950,000.00 | 53,397.95 |

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 89,249,030.69 | 179,577.41 | 69,081,097.94 | 2,213,416.43 |

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

| 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:张) | 总金额 |
| 兴业证券 | 098035 | 09闽交控债 | 新债发行 | 100,000.00 | 10,000,000.00 |
| 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:张) | 总金额 |
| - | - | - | - | - | - |

6.4.5 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

无

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购形成的卖出回购证券款余额49,999,805.00元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 080216 | 08国开16 | 2009-7-2 | 106.08 | 500,000 | 53,040,000.00 |

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无

## §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 850,697,705.21 | 31.66 |
| | 其中:股票 | 850,697,705.21 | 31.66 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,688,674,920.30 | 62.85 |
| | 其中:债券 | 1,688,674,920.30 | 62.85 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 91,644,095.09 | 3.41 |
| 6 | 其他资产 | 55,997,937.14 | 2.08 |
| 7 | 合计 | 2,687,014,657.74 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 11,457,000.00 | 0.44 |
| B | 采掘业 | 73,603,715.68 | 2.81 |
| C | 制造业 | 136,617,467.46 | 5.22 |
| C0 | 食品、饮料 | 15,237,333.48 | 0.58 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 917,280.00 | 0.04 |
| C5 | 电子 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | 79,333,470.93 | 3.03 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 18,711,405.70 | 0.72 |
| C8 | 医药、生物制品 | 22,417,977.35 | 0.86 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 7,959,259.72 | 0.30 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | 51,890,204.50 | 1.98 |
| G | 信息技术业 | 10,290,000.00 | 0.39 |
| H | 批发和零售贸易 | 62,218,969.12 | 2.38 |
| I | 金融、保险业 | 287,522,224.31 | 10.99 |
| J | 房地产业 | 121,945,356.05 | 4.66 |
| K | 社会服务业 | 76,586,713.00 | 2.93 |
| L | 传播与文化产业 | 10,606,795.37 | 0.41 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 850,697,705.21 | 32.53 |

7.3 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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000069 | 华侨城A | 2,812,570.00 | 58,782,713.00 | 2.25 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 2,087,008.00 | 58,206,653.12 | 2.23 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 1,000,000.00 | 49,460,000.00 | 1.89 |
| 4 | 601328 | 交通银行 | 5,299,920.00 | 47,752,279.20 | 1.83 |
| 5 | 601169 | 北京银行 | 2,599,968.00 | 42,275,479.68 | 1.62 |
| 6 | 600015 | 华夏银行 | 3,300,000.00 | 41,349,000.00 | 1.58 |
| 7 | 000002 | 万 科A | 3,200,000.00 | 40,800,000.00 | 1.56 |
| 8 | 000959 | 首钢股份 | 5,653,500.00 | 34,034,070.00 | 1.30 |
| 9 | 601939 | 建设银行 | 5,500,000.00 | 33,165,000.00 | 1.27 |
| 10 | 601628 | 中国人寿 | 1,074,906.00 | 29,613,660.30 | 1.13 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.nffund.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内权益投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600048 | 保利地产 | 58,129,173.41 | 3.03 |
| 2 | 000069 | 华侨城A | 50,896,453.71 | 2.66 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 49,103,717.30 | 2.56 |
| 4 | 000402 | 金 融 街 | 41,613,065.05 | 2.17 |
| 5 | 000002 | 万 科A | 40,445,381.11 | 2.11 |
| 6 | 600015 | 华夏银行 | 39,779,007.62 | 2.08 |
| 7 | 601169 | 北京银行 | 38,085,447.84 | 1.99 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 34,778,719.25 | 1.81 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 31,170,128.28 | 1.63 |
| 10 | 601919 | 中国远洋 | 27,425,835.98 | 1.43 |
| 11 | 601939 | 建设银行 | 26,957,430.19 | 1.41 |
| 12 | 000959 | 首钢股份 | 24,596,112.66 | 1.28 |
| 13 | 600325 | 华发股份 | 21,303,876.88 | 1.11 |
| 14 | 600598 | 北大荒 | 20,695,517.51 | 1.08 |
| 15 | 600028 | 中国石化 | 20,342,189.74 | 1.06 |
| 16 | 000759 | 武汉中百 | 20,315,558.27 | 1.06 |
| 17 | 002244 | 滨江集团 | 19,276,018.25 | 1.01 |
| 18 | 600479 | 千金药业 | 19,067,724.95 | 0.99 |
| 19 | 600816 | 安信信托 | 18,625,347.21 | 0.97 |
| 20 | 600269 | 赣粤高速 | 17,955,514.41 | 0.94 |

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000629 | 攀钢钒钛 | 102,757,005.16 | 5.36 |
| 2 | 600547 | 山东黄金 | 54,056,133.37 | 2.82 |
| 3 | 600739 | 辽宁成大 | 51,602,841.83 | 2.69 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 48,645,644.28 | 2.54 |
| 5 | 000402 | 金 融 街 | 45,997,454.26 | 2.40 |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 42,667,835.47 | 2.23 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 40,659,810.04 | 2.12 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 37,491,709.03 | 1.96 |
| 9 | 600325 | 华发股份 | 34,227,410.30 | 1.79 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 20,607,631.51 | 1.08 |
| 11 | 600269 | 赣粤高速 | 19,002,580.39 | 0.99 |
| 12 | 600479 | 千金药业 | 17,594,616.49 | 0.92 |
| 13 | 600377 | 宁沪高速 | 17,217,014.28 | 0