

南方证券投资基金 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
报告日期:2009年08月25日

会计主体:天元证券投资基金
报告截止日:2009年06月30日

单位:人民币元

§1 重要提示
1.1 重要提示
基金管理人承诺, 基金管理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。 基金合同于 2009 年 8 月 21 日生效, 本报告所载的财务数据、净值表现、利润分配记录、财务会计报告等内容, 均取自基金管理人提供的账目记录、会计核算记录和交易数据。
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, 也不保证基金资产总值或收益。
基金过往业绩并不代表其未来表现, 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。
本半年度报告所载数据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。
本报告所载资料未进行审计。
本报告日期自 2009 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介
2.1 基金基本情况
基金名称 南方天元封闭
买入代码 184698
基金运作方式 契约型封闭式
基金合同生效日 1999 年 08 月 25 日
报告期末基金份额总额 3,000,000,000.00
基金合同存续期 1999 年 8 月 25 日至 2014 年 8 月 25 日
基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所
上市日期 1999 年 9 月 20 日

注:1.基金在交易所行情披露净值等信息时信息披露方式为“可称为“天元””
2.本基金产品说明

投资目标 本基金属于封闭式基金, 主要投资于两个股票市场中的指数股, 本基金所称指数股是指由行业代表、蓝筹股、高成长性个股、分红稳定的标准而由计算机筛选出来的绩优上市公司, 本基金的投资目标和投资策略是在充分分散投资的前提下, 以稳健的投资原则, 确保基金资产安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略 本基金管理人、本基金投资人的研究, 选取具有行业代表性、股票质地良好、资本增值潜力较大、分红稳定特定的指数股上市公司, 进行中长期投资, 以稳健的投资原则, 力求确保基金资产安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

§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
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标
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
3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

§4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.2 基金管理人履行职责的情况
4.3 基金管理人内部控制的专项说明
4.4 基金管理人内部控制的专项说明

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 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股票投资组合
5.4 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权证投资组合
5.5 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债券投资组合
5.6 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权证投资组合
5.7 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权证投资组合
5.8 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权证投资组合

§6 开放式基金份额变动
6.1 基金份额持有人户数、户数变动及持有人结构
6.2 基金份额持有人户数、户数变动及持有人结构
6.3 基金份额持有人户数、户数变动及持有人结构
6.4 基金份额持有人户数、户数变动及持有人结构

§7 基金业绩
7.1 基金业绩
7.2 基金业绩
7.3 基金业绩
7.4 基金业绩

§8 基金管理人及基金经理情况
8.1 基金管理人及基金经理情况
8.2 基金管理人及基金经理情况
8.3 基金管理人及基金经理情况
8.4 基金管理人及基金经理情况

§9 基金业绩
9.1 基金业绩
9.2 基金业绩
9.3 基金业绩
9.4 基金业绩

§10 基金管理人及基金经理情况
10.1 基金管理人及基金经理情况
10.2 基金管理人及基金经理情况
10.3 基金管理人及基金经理情况
10.4 基金管理人及基金经理情况

§11 基金业绩
11.1 基金业绩
11.2 基金业绩
11.3 基金业绩
11.4 基金业绩

§12 基金管理人及基金经理情况
12.1 基金管理人及基金经理情况
12.2 基金管理人及基金经理情况
12.3 基金管理人及基金经理情况
12.4 基金管理人及基金经理情况

§13 基金业绩
13.1 基金业绩
13.2 基金业绩
13.3 基金业绩
13.4 基金业绩

§14 基金管理人及基金经理情况
14.1 基金管理人及基金经理情况
14.2 基金管理人及基金经理情况
14.3 基金管理人及基金经理情况
14.4 基金管理人及基金经理情况

§15 基金业绩
15.1 基金业绩
15.2 基金业绩
15.3 基金业绩
15.4 基金业绩

§16 基金管理人及基金经理情况
16.1 基金管理人及基金经理情况
16.2 基金管理人及基金经理情况
16.3 基金管理人及基金经理情况
16.4 基金管理人及基金经理情况

§17 基金业绩
17.1 基金业绩
17.2 基金业绩
17.3 基金业绩
17.4 基金业绩

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日	上期 2008年12月31日
资产		
银行存款	41,127,515.34	159,696,086.56
结算备付金	9,714,996.72	4,358,039.17
存出保证金	2,741,332.12	1,098,780.49
交易性金融资产	4,351,289,432.47	2,844,707,341.85
其中:股票投资	3,455,875,945.67	1,766,507,627.56
债券投资	895,413,486.80	1,078,199,714.29
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	13,322,183.80
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	182,160,000.00	-
应收利息	24,399,104.51	20,074,527.33
应收股利	3,591,404.17	0
应收申购款	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,615,023,785.33	3,043,256,959.20

项目	本期 2009年06月30日	上期 2008年12月31日
负债和所有者权益		
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	179,999,530.00	-
应付证券清算款	28,742,137.66	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
应付管理人报酬	5,175,072.17	4,003,641.29
应付托管费	862,512.05	667,273.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,668,495.18	1,741,443.86
应交税费	2,055,456.49	2,055,456.49
应付利息	29,140.65	-
应付股利	-	-
其他负债	2,962,408.87	3,349,500.00
负债合计	221,514,953.07	33,693,366.07
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	1,393,508,832.26	5,563,573.13
所有者权益合计	4,383,508,832.26	3,009,563,573.13
负债和所有者权益总计	4,615,023,785.33	3,043,256,959.20

注:1.本基金在交易所行情披露净值等信息时信息披露方式为“可称为“天元””
2.本基金产品说明

投资目标 本基金属于封闭式基金, 主要投资于两个股票市场中的指数股, 本基金所称指数股是指由行业代表、蓝筹股、高成长性个股、分红稳定的标准而由计算机筛选出来的绩优上市公司, 本基金的投资目标和投资策略是在充分分散投资的前提下, 以稳健的投资原则, 确保基金资产安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略 本基金管理人、本基金投资人的研究, 选取具有行业代表性、股票质地良好、资本增值潜力较大、分红稳定特定的指数股上市公司, 进行中长期投资, 以稳健的投资原则, 力求确保基金资产安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

§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
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标
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
3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

§4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.2 基金管理人履行职责的情况
4.3 基金管理人内部控制的专项说明
4.4 基金管理人内部控制的专项说明

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 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股票投资组合
5.4 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权证投资组合
5.5 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债券投资组合
5.6 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权证投资组合
5.7 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权证投资组合
5.8 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权证投资组合

§6 开放式基金份额变动
6.1 基金份额持有人户数、户数变动及持有人结构
6.2 基金份额持有人户数、户数变动及持有人结构
6.3 基金份额持有人户数、户数变动及持有人结构
6.4 基金份额持有人户数、户数变动及持有人结构

§7 基金业绩
7.1 基金业绩
7.2 基金业绩
7.3 基金业绩
7.4 基金业绩

§8 基金管理人及基金经理情况
8.1 基金管理人及基金经理情况
8.2 基金管理人及基金经理情况
8.3 基金管理人及基金经理情况
8.4 基金管理人及基金经理情况

§9 基金业绩
9.1 基金业绩
9.2 基金业绩
9.3 基金业绩
9.4 基金业绩

§10 基金管理人及基金经理情况
10.1 基金管理人及基金经理情况
10.2 基金管理人及基金经理情况
10.3 基金管理人及基金经理情况
10.4 基金管理人及基金经理情况

§11 基金业绩
11.1 基金业绩
11.2 基金业绩
11.3 基金业绩
11.4 基金业绩

§12 基金管理人及基金经理情况
12.1 基金管理人及基金经理情况
12.2 基金管理人及基金经理情况
12.3 基金管理人及基金经理情况
12.4 基金管理人及基金经理情况

§13 基金业绩
13.1 基金业绩
13.2 基金业绩
13.3 基金业绩
13.4 基金业绩

§14 基金管理人及基金经理情况
14.1 基金管理人及基金经理情况
14.2 基金管理人及基金经理情况
14.3 基金管理人及基金经理情况
14.4 基金管理人及基金经理情况

§15 基金业绩
15.1 基金业绩
15.2 基金业绩
15.3 基金业绩
15.4 基金业绩

§16 基金管理人及基金经理情况
16.1 基金管理人及基金经理情况
16.2 基金管理人及基金经理情况
16.3 基金管理人及基金经理情况
16.4 基金管理人及基金经理情况

§17 基金业绩
17.1 基金业绩
17.2 基金业绩
17.3 基金业绩
17.4 基金业绩

6.4.4.2 基金托管费
单位:人民币元

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日	上期 2008年12月31日
当期应支付的托管费	4,577,992.09	8,692,558.92
其中:当期已支付	3,715,480.04	7,860,465.77
期末未支付	862,512.05	832,093.15

注:本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 0.25% 的费率计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付。
其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。
6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 询价/回购/交易
无
6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.4.4.1 报告期内本基金投资于关联方投资本基金的情况
份额单位:份

项目	本期 2009年01月01日至2009年06月30日	上期 2008年12月31日
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购买入总份额	-	-
期间赎回卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额的比例	0.33%	0.33%

6.4.4.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
份额单位:份

关联方名称	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券	18,547,100.00	0.62%	-	-
南方证券	10,000,000.00	0.33%	10,000,000.00	0.33%
广发证券	5,000,000.00	0.17%	10,000,000.00	0.33%

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
单位:人民币元

关联方名称	2009年01月01日至2009年06月30日	2008年01月01日至2008年06月30日
中国工商银行	41,127,515.34	611,651.77
期末余额	41,127,515.34	267,196,411.15
当期利息收入	611,651.77	2,824,134.00

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 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量(单位:股)	总金额
兴业证券	600491	龙元建设	非公开发行	580,000.00	4,176,000.00

6.4.5 基金业绩
6.4.5.1 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
6.4.5.2 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较
6.4.5.3 基金业绩
6.4.5.4 基金业绩
6.4.5.5 基金业绩

§7 投资组合报告
7.1 报告期末基金资产组合情况
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
7.3 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股票投资组合
7.4 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权证投资组合
7.5 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债券投资组合
7.6 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权证投资组合
7.7 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权证投资组合
7.8 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权证投资组合

§8 基金管理人及基金经理情况
8.1 基金管理人及基金经理情况
8.2 基金管理人及基金经理情况
8.3 基金管理人及基金经理情况
8.4 基金管理人及基金经理情况

§9 基金业绩
9.1 基金业绩
9.2 基金业绩
9.3 基金业绩
9.4 基金业绩

§10 基金管理人及基金经理情况
10.1 基金管理人及基金经理情况
10.2 基金管理人及基金经理情况
10.3 基金管理人及基金经理情况
10.4 基金管理人及基金经理情况

§11 基金业绩
11.1 基金业绩
11.2 基金业绩
11.3 基金业绩
11.4 基金业绩

§12 基金管理人及基金经理情况
12.1 基金管理人及基金经理情况
12.2 基金管理人及基金经理情况
12.3 基金管理人及基金经理情况
12.4 基金管理人及基金经理情况

§13 基金业绩
13.1 基金业绩
13.2 基金业绩
13.3 基金业绩
13.4 基金业绩

§14 基金管理人及基金经理情况
14.1 基金管理人及基金经理情况
14.2 基金管理人及基金经理情况
14.3 基金管理人及基金经理情况
14.4 基金管理人及基金经理情况

§15 基金业绩
15.1 基金业绩
15.2 基金业绩
15.3 基金业绩
15.4 基金业绩

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	600030	中信证券	196,064,341.79	6.51
2	000858	五粮液	141,327,826.84	4.70
3	600015	华鲁银行	131,730,038.38	4.38
4	000037	华鲁银行	104,796,269.80	3.48
5	600739	辽宁成大	101,547,419.76	3.37
6	600583	海油工程	102,128,108.30	3.26
7	000528	桐庐精工	89,539,959.79	2.88
8	000002	万科 A	89,578,025.95	2.65
9	000898	碧辟股份	75,064,769.21	2.49
10	600055	海螺水泥	69,818,566.05	2.32
11	600080	浦发银行	68,977,343.99	2.29
12	600177	雅戈尔	62,101,187.84	2.06
13	600785	新华百货	61,369,917.75	2.04
14	000895	双汇发展	61,105,360.60	1.93
15	000948	南天信息	60,014,199.49	2.00
16	600547	山东黄金	59,255,855.35	1.97
17	601766	中国南车	56,370,202.25	1.87
18	000063	中兴通讯	55,874,040.85	1.86
19	600729	重庆百货	54,175,826.56	1.80
20	000001	深发展 A	53,820,780.95	1.79

注:1.买入金额含二级市场买入的申购、赎回、申购、赎回、发行认购及行权等减少的股票, 卖出金额按成交金额 成交均价扣除交易费用 计算, 不考虑相关交易费用。
2.买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额 成交均价扣除交易费用 计算, 不考虑相关交易费用。
7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资组合
金额单位:人民币元

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国信转债	103,511,986.80	2.36
2	央行票据	701,466,500.00	15.97
3	金融债	90,295,000.00	2.06
4	企业债	90,295,000.00	2.06
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	895,413,486.80	20.38

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资组合
金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080108	08央票108	1,500,000	145,185,000.00	3.20
2	080104	08央票104	1,400,000	135,310,000.00	3.08
3	080112	08央票112	1,350,000	131,152,500.00	2.99
4	080102	08央票92	1,000,000	96,440,000.00	2.20
5	050406	05发债06	500,000	50,255,000.00	1.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资组合
7.8 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组合
7.9 投资组合报告注
7.9.1 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体经监管部门立案调查的, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
7.9.2 本基金本期投资的前十名证券中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
7.9.3 其他资产构成
单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,741,332.12
2	应收证券清算款	182,160,000.00
3	应收股利	3,591,404.17
4	应收申购款	24,399,104.51
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	212,891,840.80

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
8.1 基金管理人及基金经理情况
8.2 基金管理人及基金经理情况
8