南方成份精选股票型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010年12月31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:2011年3月29日

§1 重要提示及目录

1.1 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。本年度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2011年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方成份精选股票
基金主代码	202005
前端交易代码	202005
后端交易代码	202006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年5月14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
报告期末基金份额总额	11,944,144,943.73份
基金合同存续期间	不定期

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“南方成份”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持公司一贯投资理念基础上,通过对宏观经济和上市公司基本面的深入研究,采取定量和定性相结合方法,精选成份股,寻找驱动力强的领先上市公司,在控制风险的前提下追求获取超额收益。
投资策略	本基金在保持公司一贯投资理念的基础上,紧密把握和跟踪中国宏观经济周期、行业增长周期和企业成长周期,通过对行业的深入分析和上市公司基本面的研究,主要投资两类企业:1.驱动力强增长行业:通过对中国宏观经济的把握,根据对上游行业运行态势与利益分配等因素的观察,考量行业增长周期,以确定对国民经济起主要驱动作用或作出重大贡献的行业/产业,从中优选代表性企业重点投资。2.行业领先型成长企业:强调处于企业成长生命周期的上升期,或面临重大的发展机遇,具备超常规增长潜力的上市公司。通过投资此两类公司,进而为本基金获取中长期稳健的资产增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于风险收益配比较高的品种

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	赵会军
	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

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	1,539,192,465.31	934,156,793.56	-6,094,953,817.10
本期利润	-908,355,538.83	5,653,932,971.79	-13,552,478,386.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0708	0.3748	-0.7769
本期基金份额净值增长率	-6.56%	53.18%	-52.84%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2097	0.1114	0.0404
期末基金资产净值	11,372,535,936.91	13,938,432,963.84	10,986,589,850.80
期末基金份额净值	0.9521	1.0392	0.6784

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)。

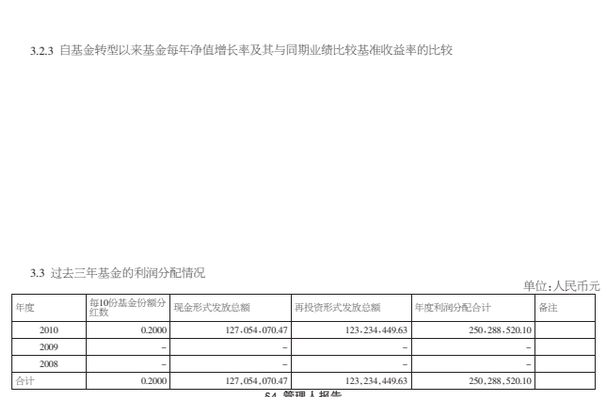
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

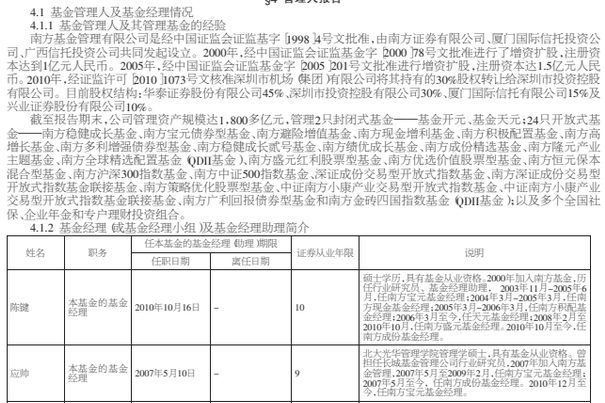
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	8.32%	1.69%	5.31%	1.42%	3.01%	0.27%
过去六个月	24.96%	1.46%	17.68%	1.24%	7.28%	0.22%
过去一年	-6.56%	1.47%	-9.12%	1.26%	2.56%	0.21%
过去三年	-32.49%	1.75%	-30.86%	1.86%	-1.63%	-0.11%
自基金转型起至今	-2.90%	1.75%	-7.42%	1.86%	4.52%	-0.11%

3.2.2 自基金转型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变动的比较



3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	应分配份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	0.2000	127,054,070.47	123,234,449.63	250,288,520.10	
2009	-	-	-	-	
2008	-	-	-	-	
合计	0.2000	127,054,070.47	123,234,449.63	250,288,520.10	

§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金字[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金字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。2010年,经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场(集团)有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司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;24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、南方全球精选配置基金(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基金、南方沪深300指数基金、南方中证500指数基金、深证成份交易型开放式指数基金、南方深证成份交易型开放式指数基金联接基金、南方策略优化股票型基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金联接基金、南方广利回报债券型基金和南方金砖四国指数基金(QDII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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈健	本基金的基金经理	2010年10月16日	-	10	硕士学历,具有基金从业资格。2000年加入南方基金,历任行业研究员、基金经理助理。2003年11月-2005年6月,任南方宝元基金经理;2004年3月-2005年3月,任南方现金基金经理;2005年3月-2006年3月,任南方积配基金经理;2006年3月至今,任天元基金经理;2008年2月至2010年10月,任南方盛元基金经理。2010年10月至今,任南方成份基金经理。
应帅	本基金的基金经理	2007年5月10日	-	9	北大光华管理学院管理学硕士,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。2010年12月至今,任南方宝元基金经理。
张慎平	本基金的基金经理	2008年4月10日	-	7	注册金融分析师(CFA),经济学硕士,具有基金从业资格。2003年加入南方基金,负责石化化工、建筑建材行业研究。2008年1月至2010年1月,任南方积配基金经理;2008年4月至2011年2月,任南方成份基金经理。2010年1月至2011年2月,任南方稳健、南松贰号基金经理。
欧阳凡	本基金的基金经理助理	2008年1月14日		4	北京大学金融学硕士。2007年加入南方基金,现任TMT行业、中小股票首席研究员;2008年1月至今,任南方绩优、南方成分基金经理助理。
吴国清	本基金的基金经理助理	2010年10月18日		3	清华大学经济学博士。2007年加入南方基金,现任有色金属行业首席研究员;2010年10月至今,任南方成分基金经理助理。

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。

3.南方基金管理公司于2011年2月17日可查调整基金经理的公告,免去张慎平先生南方成份精选股票型证券投资基金基金经理职务。调整后,南方成份精选股票型证券投资基金将由陈健先生、应帅先生共同管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《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、《南方成份精选股票型证券投资基金合同》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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在上半年主要采取相对均衡的配置策略,仓位维持稳定。在行业配置方面,相对看好以内需增长为主要增长驱动力的消费、医药等内需型行业,行业内选股坚持寻找领先型成长企业的策略。进入下半年,随着市场在三季度触底反弹,以消费和医药为代表的内需型行业在短暂调整后开始大幅度回升,以汽车和工程机械为代表的低估值周期类板块在大幅度调整后获得了超额收益,而以金融地产、钢铁和航运为代表的周期类股票继续进行调整。本基金在相对均衡配置的情况下,超配了家电、汽车和消费品行业,仓位维持较高水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010年全年沪深300指数下跌12.51%,成份精选净值增长率为-6.56%,业绩基准为-9.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年一季度,中国宏观经济处于“高经济增长、高通胀压力”的运行态势中,一方面全球流动性仍然受到美国量化宽松货币政策的影响处于比较充裕状态,这一点从美国10年期国债收益率仍基本处于过去两年来的中轴水平,以及我国2011年1月份的新增外汇占款仍上升较快都可以观察出来,充裕的流动性在支持需求复苏的同时,也给全球带来了较大的通胀压力;另一方面,国内的经济增长动力强劲,工业企业盈利普遍改善,ROE水平接近历史高位,进入2011年,部分行业的月度数据已经显示出相比2010年继续高速增长的良好态势。虽然政策面为了对冲通胀压力和防止资产泡沫,继续出台了上调存款准备金、加息、房产限购等一系列紧缩措施,货币市场利率水平也相对高企,但是股票市场并未出现恐慌下跌,表现出在流动性充裕和权重行业低估值下的韧性。

展望下一阶段,成份精选基金在选择驱动行业层面,将重点着眼于内需消费和先进制造两大领域,在行业内挖掘企业时,将着重寻找能够通过资源优势、品牌优势或管理优势,持续提高市场占有率和利润水平的领先企业。

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、数量化投资部总监、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,且具有风险、会规、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:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的90%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红,但未经确权的基金份额默认方式是红利再投资;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据上述收益分配原则,本报告期内本基金在满足分红条件的情况下,于2010年11月1日进行了收益分配,每10份派0.20元。本基金将在满足分红条件的情况下继续安排分红。

§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

2010年,本基金托管人在对南方成份精选股票型证券投资基金的托管过程中,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

2010年,南方成份精选股票型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方成份精选股票型证券投资基金的投资运作、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,南方成份精选股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为250,288,520.10元。

5.3 托管人对本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成份精选股票型证券投资基金2010年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。

§6 审计报告

本基金2010年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2011)第20314号“标准无保留意见的审计报告”,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.4.5	637,138,858.04	629,943,036.25
结算备付金		21,040,830.05	-
存出保证金		1,310,889.08	3,201,715.14
交易性金融资产		10,816,028,064.59	13,695,643,905.97
其中:股票投资		10,166,473,333.59	12,997,952,467.77
基金投资		-	-
债券投资		649,554,731.00	697,691,438.20
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		150,000,000.00	41,665,997.10
应收利息		8,749,938.35	380,492.99
应收股利		-	-
应收申购款		1,574,581.95	494,972.29
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		11,635,843,162.06	14,371,330,119.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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		-	350,063,354.90
应付证券清算款		227,410,559.79	30,887,191.61
应付赎回款		3,451,733.22	20,244,617.75
应付管理人报酬		14,679,666.57	17,744,382.97
应付托管费		2,446,611.08	2,957,397.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		14,119,634.23	9,488,969.07
应交税费		427,228.96	427,228.96
应付利息		-	46,312.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		771,791.30	1,037,701.17
负债合计		263,307,225.15	432,897,155.90
所有者权益:			
实收基金		3,726,487,485.53	4,184,537,955.08
未分配利润		7,646,048,451.38	9,753,895,008.76
所有者权益合计		11,372,535,936.91	13,938,432,963.84
负债和所有者权益总计		11,635,843,162.06	14,371,330,119.74

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.9521元,基金份额总额11,944,144,943.73份。

7.2 利润表

会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日 至 2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		-644,149,773.91	5,958,160,694.07
1.利息收入		15,141,329.48	50,734,159.26
其中:存款利息收入		3,509,105.49	3,874,181.30
债券利息收入		11,411,893.69	46,859,977.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		220,330.30	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,787,747,508.00	1,186,672,199.74
其中:股票投资收益		1,684,174,139.05	1,063,239,357.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,589,924.46	26,547,926.34
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	250,440.70
股利收益		101,983,444.49	96,634,475.65
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-2,447,548,004.14	4,719,776,178.23
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		509,392.75	978,156.84
减:二、费用		264,205,764.92	304,227,722.28
1.管理人报酬	7.4.4.2.1	176,946,572.39	200,606,940.29
2.托管费	7.4.4.2.2	29,491,095.47	33,434,490.17
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		57,210,409.64	69,145,584.85
5.利息支出		67,175.03	548,860.57
其中:卖出回购金融资产支出		67,175.03	548,860.57
6.其他费用		490,512.39	491,846.40
三、利润总额		-908,355,538.83	5,653,932,971.79
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-908,355,538.83	5,653,932,971.79

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方成份精选股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日 至 2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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)	4,184,537,955.08	9,753,895,008.76	13,938,432,963.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-908,355,538.83	-908,355,538.83
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)	-458,050,469.55	-949,202,498.45	-1,407,252,968.00
其中:1.基金申购款	161,811,094.44	351,054,030.55	512,865,124.99
2.基金赎回款	-619,861,563.99	-1,300,256,529.00	-1,920,118,092.99
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)	-	-250,288,520.10	-250,288,520.10
五、期末所有者权益(基金净值)	3,726,487,485.53	7,646,048,451.38	11,372,535,936.91
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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)	5,052,636,416.73	5,933,953,434.07	10,986,589,850.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,653,932,971.79	5,653,932,971.79
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)	-868,098,461.65	-1,833,991,397.10	-2,702,089,858.75
其中:1.基金申购款	106,209,621.08	202,350,259.05	308,559,880.13
2.基金赎回款	-974,308,082.73	-2,036,341,656.15	-3,010,649,738.88
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)	4,184,537,955.08	9,753,895,008.76	13,938,432,963.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

高良玉 鲍文革 鲍文革

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1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与最近一期年度报告完全一致。

7.4.2会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1会计政策变更的说明

无。

7.4.2.2会计估计变更的说明

无。

7.4.2.3差错更正的说明

无。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(南方基金公司)	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
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司()	基金管理人的股东(2010年9月10日起)
深圳市机场(集团)有限公司()	基金管理人的原股东(2010年9月10日前)

注:()根据基金管理人南方基金公司2009年第一次临时股东会会议决议以及中国证监会证监许可[2010]1073号《关于核准南方基金管理有限公司变更股权的批复》核准,深圳市投资控股有限公司受让深圳市机场(集团)有限公司持有的南方基金公司30%的股权,南方基金公司于2010年9月10日完成了工商登记变更手续。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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(%)
兴业证券	1,546,672,542.41	4.20	-	-
华泰证券	1,173,999,301.38	3.19	10,183,316,721.16	22.60

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31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(%)
兴业证券	1,256,681.68	4.08	1,167,556.52	8.27
华泰证券	973,556.51	3.16	458,066.50	3.24
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	8,655,773.37	22.90	1,049,359.05	11.06
兴业证券	-	-	-	-

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和经手费后的净额列示。

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	176,946,572.39	200,606,940.29
其中:支付给销售机构的客户维护费	25,796,318.01	28,999,139.84

注: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1.5%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 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	29,491,095.47	33,434,490.17

注: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0.25%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 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
	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	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
	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	-	-	-	-	500,080,000.00	87,185.30

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金合同生效日(2007年5月14日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	85,535,431.62	85,535,431.62
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	85,535,431.62	85,535,431.62
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.72%	0.64%

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	637,138,858.04	3,335,487.29	629,943,036.25	3,614,997.59

注: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。

7.4.4.6 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

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601933	永辉超市	2010年12月9日	2011年3月15日	网下申购	23.98	31.24	49,465	1,186,170.70	1,545,286.60	-
600998	九州通	2010年10月27日	2011年2月9日	网下申购	13.00	14.55	89,034	1,157,442.00	1,295,444.70	-
601126	四方股份	2010年12月28日	2011年3月31日	网下申购	23.00	31.11	26,982	620,586.00	839,410.02	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	2,964,198.70	3,680,141.32	-

7.4.5.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.5.1.3 受限证券类别:权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600518	康美药业	2010年12月28日	配股停牌	19.71	2011年1月6日	17.29	9,561,672	139,687,899.06	188,460,555.12	-
600816	安信信托	2010年6月2日	重大项目公告	13.60	未知	未知	9,148,394	182,280,420.80	124,418,158.40	-
600664	哈药股份	2010年12月29日	资产重组	22.57	2011年2月16日	24.83	1,923,800	43,903,009.50	43,420,166.00	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	365,871,329.36	356,298,879.52	-

注:本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§8 投资组合报告

8.1 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	10,166,473,333.59	87.37
	其中:股票	10,166,473,333.59	87.37
2	固定收益投资	649,554,731.00	5.58
	其中:债券	649,554,731.00	5.58
	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	658,179,688.09	5.66
6	其他各项资产	161,635,409.38	1.39
7	合计	11,635,843,162.06	100.00

8.2 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	-	-
B	采掘业	943,278,058.93	8.29
C	制造业	5,081,609,024.56	44.68
C0	食品、饮料	1,500,623,083.48	13.20
C1	纺织、服装、皮毛	20,177,659.32	0.18
C2