

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2011年8月25日

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

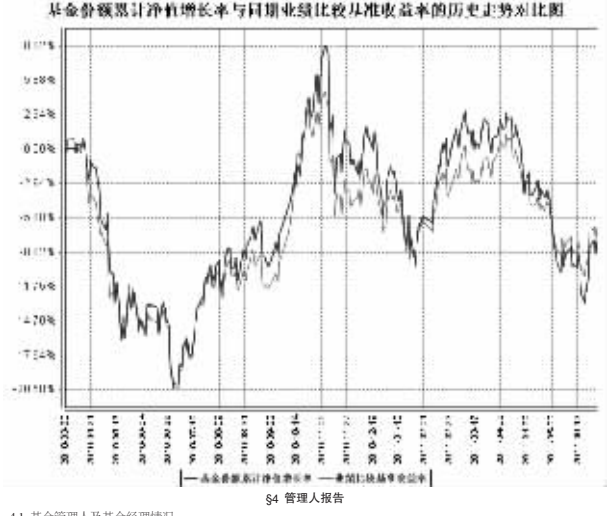
Table with 2 columns: Item and Value. Includes sections for 2.1 基金基本情况, 2.2 基金产品说明, and 2.3 基金管理人及基金托管人.

Table with 3 columns: Item, Fund Manager, and Custodian. Includes information about the fund manager and custodian.

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 4 columns: Item, Report Period, and Value. Includes 3.1.1 期间数据和指标 and 3.1.2 期末数据和指标.

3.2 基金净值表现



4.1 基金管理人及基金基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金基金经理简介

Table with 4 columns: Name, Position, Tenure, and Description. Lists the fund manager and other key personnel.

注:1、任职日期为基金合同生效日。
2、离职日期为根据合同约定确定的离职日期。

4.3 管理人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

4.3.2 投资组合与其他投资风格相似的投资组合的情况
4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 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业绩表现的说明

4.4.2 报告期内基金业绩表现
4.4.3 报告期内基金业绩表现归因

4.5 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.5.1 报告期内基金估值程序的重大变更

4.6 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.6.1 报告期内基金估值程序的重大变更

4.7 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.7.1 报告期内基金估值程序的重大变更

4.8 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.8.1 报告期内基金估值程序的重大变更

4.9 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.9.1 报告期内基金估值程序的重大变更

4.10 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.10.1 报告期内基金估值程序的重大变更

4.11 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.11.1 报告期内基金估值程序的重大变更

4.12 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.12.1 报告期内基金估值程序的重大变更

4.13 管理人报告期内基金估值程序的重大变更
4.13.1 报告期内基金估值程序的重大变更

6.1 资产负债表

Table with 3 columns: Item, 2011年6月30日, and 2010年12月31日. Shows the balance sheet for the fund.

Table with 3 columns: Item, 2011年6月30日, and 2010年12月31日. Shows the balance sheet for the fund.

6.2 利润表

Table with 3 columns: Item, 2011年1月1日至2011年6月30日, and 2010年1月1日至2010年6月30日. Shows the profit and loss statement.

6.3 所有者权益变动表

Table with 4 columns: Item, 2011年1月1日, 2011年6月30日, 2010年1月1日, and 2010年6月30日. Shows the equity statement.

注:1、净利润是指归属于母公司的净利润。
2、净利润是指归属于母公司的净利润。

6.4 现金流量表

Table with 3 columns: Item, 2011年1月1日至2011年6月30日, and 2010年1月1日至2010年6月30日. Shows the cash flow statement.

6.5 公允价值

Table with 3 columns: Item, 2011年6月30日, and 2010年6月30日. Shows the fair value statement.

6.6 关联方关系

Table with 3 columns: Item, 2011年1月1日至2011年6月30日, and 2010年1月1日至2010年6月30日. Shows the related party transactions.

6.7 或有事项

6.7.1 资产负债表日后事项
6.7.2 或有事项

6.8 承诺事项

6.8.1 资产负债表日后事项
6.8.2 或有事项

6.9 资产负债表日后事项

6.9.1 资产负债表日后事项
6.9.2 或有事项

6.10 资产负债表日后事项

6.10.1 资产负债表日后事项
6.10.2 或有事项

6.10.3 资产负债表日后事项
6.10.4 或有事项

6.11 资产负债表

Table with 3 columns: Item, 2011年1月1日至2011年6月30日, and 2010年1月1日至2010年6月30日. Shows the balance sheet for the fund.

6.12 利润表

Table with 3 columns: Item, 2011年1月1日至2011年6月30日, and 2010年1月1日至2010年6月30日. Shows the profit and loss statement.

6.13 所有者权益变动表

Table with 4 columns: Item, 2011年1月1日, 2011年6月30日, 2010年1月1日, and 2010年6月30日. Shows the equity statement.

6.14 现金流量表

Table with 3 columns: Item, 2011年1月1日至2011年6月30日, and 2010年1月1日至2010年6月30日. Shows the cash flow statement.

6.15 公允价值

Table with 3 columns: Item, 2011年6月30日, and 2010年6月30日. Shows the fair value statement.

6.16 关联方关系

Table with 3 columns: Item, 2011年1月1日至2011年6月30日, and 2010年1月1日至2010年6月30日. Shows the related party transactions.

6.17 或有事项

6.17.1 资产负债表日后事项
6.17.2 或有事项

6.18 承诺事项

6.18.1 资产负债表日后事项
6.18.2 或有事项

6.19 资产负债表日后事项

6.19.1 资产负债表日后事项
6.19.2 或有事项

6.20 资产负债表日后事项

6.20.1 资产负债表日后事项
6.20.2 或有事项

6.21 资产负债表日后事项

6.21.1 资产负债表日后事项
6.21.2 或有事项

6.22 资产负债表日后事项

6.22.1 资产负债表日后事项
6.22.2 或有事项

6.23 资产负债表日后事项

6.23.1 资产负债表日后事项
6.23.2 或有事项

6.24 资产负债表日后事项

6.24.1 资产负债表日后事项
6.24.2 或有事项

6.25 资产负债表日后事项

6.25.1 资产负债表日后事项
6.25.2 或有事项

6.25.3 资产负债表日后事项
6.25.4 或有事项

注:买入包括二级市场主动买入的新股、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 成交净价 或成交量 均价,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

Table with 5 columns: 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. Lists the top 20 stocks bought.

注:1、上述期间二级市场买入金额计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券登记费和手续费后的净额列示。
2、该期间买入的股票投资范围包括新股申购及为基金提供的证券投资研究成果和信息服务等。

7.4.3 买入股票的成本及支出金额

Table with 2 columns: 买入股票成本 成交金额, 卖出股票成本 成交金额. Shows the cost and amount of stock transactions.

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例. Lists the bond portfolio.

注:1、支付基金管理人中国工商银行的费用按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。
2、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,逐日累计至每月月末,按月支付。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例. Lists the top 5 bonds.

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资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 资产支持证券名称, 数量(元), 公允价值, 占基金资产净值比例. Lists the top 10 asset-backed securities.

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明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例. Lists the top 5 warrants.

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的十名证券的发行人主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
7.9.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.10 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Lists other assets.

8.1 期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 资产类别, 公允价值, 占基金资产净值比例. Shows the asset allocation.

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 5 columns: 代码, 行业名称, 公允价值, 占基金资产净值比例. Shows the industry breakdown of stocks.

8.3 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明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金资产净值比例. Lists the top 10 stocks.

8.4 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 公允价值, 占基金资产净值比例. Lists the top 5 warrants.

8.5 投资组合报告附注

8.5.1 本基金投资的十名证券的发行人主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
8.5.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.6 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Lists other assets.