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

南方盛元红利股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 月 30 日

§1 重要提示

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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 8 月 20 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报报告正文,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 2011 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方盛元红利股票
基金主代码	202009
前端交易代码	202009
后端交易代码	202010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 3 月 21 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,156,756,192.37 份
基金合同存续期	不定期

注:1、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“南方盛元”;

2、本基金合同生效后一年内为封闭式,基金合同生效满一年后转为开放式,本基金已于 2009 年 3 月 23 日转为开放式。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金,重点投资于具备持续良好盈利和分红能力、分红政策稳定的上市公司,以及高信息固定收益类投资品种。同时积极把握资本利得机会以拓展收益空间,力争为投资者谋求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	90%×上证红利指数+10%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	尹东
	联系电话	0755-82763888	010-67595003
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853

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(2011 年 1 月 1 日 - 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,610,936.32
本期利润	-132,164,238.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0439
本期基金份额净值增长率	-3.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0333
期末基金资产净值	3,051,715,971.38
期末基金份额净值	0.967

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	5.68%	1.22%	-1.11%	0.99%	6.79%	0.23%
过去三个月	-5.62%	1.22%	-6.13%	0.95%	0.51%	0.27%
过去六个月	-3.80%	1.43%	-0.58%	1.03%	-3.22%	0.40%
过去一年	20.87%	1.46%	9.29%	1.15%	11.58%	0.31%
过去三年	21.98%	1.56%	-1.94%	1.82%	23.92%	-0.26%
自基金合同生效起至今	6.48%	1.55%	-33.34%	1.98%	39.82%	-0.43%

注:本基金的业绩比较基准为 90%×上证红利指数+10%×上证国债指数。

3.2.2 自基金合同生效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收益率变动的比较

注:根据本基金合同,封闭期内,本基金大类资产投资的比例为:股票 60%-100%,债券、货币市场工具及其他金融工具占 0-40%,权证 0-3%,资产支持证券 0-20%,现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例最低可以为 0;封闭期届满转型为开放式基金后,本基金大类资产投资的比例为:股票 60%-95%,债券、货币市场工具及其他金融工具占 0-35%,权证 0-3%,资产支持证券占基金资产净值的 0-20%,现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。根据相关法律法规和基金合同,本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时,本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

§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,公司管理资产规模近 1,900 亿元,管理 2 只封闭式基金——基金开元、基金天元;27 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)、南方优选成长混合型基金、南方中证 50 债券指数基金和南方保本混合型基金;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		
蒋峰	本基金的基金经理	2010年 10 月 16 日	-	10	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 2010 年 12 月,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;2010 年 10 月至今,任南方盛元基金经理;2011 年 6 月至今,任南方保本基金经理。
张旭	本基金的基金经理助理	2010年 12 月 21 日	-	2	中央财大金融学硕士,2008 年加入南方基金,曾任金融及地产行业研究员、现任高级宏观策略研究员;2010 年 12 月至今,任南方盛元基金经理助理。

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。

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、《南方盛元红利股票型证券投资基金基金合同》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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年,政府为应对通胀压力而持续实施紧缩政策,市场整体呈现震荡回落格局,报告期内沪深 300 指数涨幅为-2.69%。涨幅领先的包括基础建设相关的建材、钢铁,低估值的银行、地产,以及代表中国优势制造的家电等板块,基本符合我们年初看好的蓝筹股价值回归的投资策略。跌幅最大的板块集中在估值较高而业绩增速低于预期的 TMT、医药等行业。

报告期内,本基金基于对上半年中国 A 股市场是“通货膨胀阴影下结构机会”的基本判断,维持了权益类资产较高的配置比重,行业配置上继续重点配置上游周期类行业、房地产、建材以及中国优势制造业等板块,同时在板块内部坚持精选个股的策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 0.967 元,报告期内,份额净值增长率为-3.80%,同期业绩基准增长率为-0.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受紧缩的宏观调控影响,今年上半年我国经济呈现增速回落、通胀高企的格局,市场对通胀的担忧情绪十分浓重。但我们认为,通胀可控不可怕,流动性的持续收缩和经济的回落将会导致通胀回落,现阶段正处于从经济回落向通胀回落传导的时滞期内。另一方面,经济增速回落是宏观政策主动调控的结果,并不是经济本身出现了问题,因此经济增长出现“硬着陆”的可能性不大。当前经济回落导致“去库存”压力增加,但盈利增速回落有限,去库存的时间和力度决定了盈利预期的变化。

展望下一阶段,我们认为:在全球经济放缓,通货膨胀压力减轻的背景下,存在着紧缩结构性放松的机会,特别的,美债评级下调将加速政策拐点的出现。同此逻辑,国内经济下半年通胀大概率见顶回落,同时下半年经济走势或会逐季回落,因此,有望进入政策效果的观察期,对资本市场也将出现结构性投资机会。我们将紧密跟踪经济面的前瞻性指标,动态评估政策导向和资本市场的反应。另一方面,A 股整体估值仍处于历史上较低的估值水平,降低了大盘系统性风险的概率。

下半年,我们看好的板块包括:①看好身处上游具备较强资源扩张能力的上市公司;②本现中国优势,需求稳定且高壁垒的制造业,特别是积极关注前期超跌而下半年有较好基本面支撑的电力设备等板块的投资机会;③有品牌张力的消费品行业。

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:本基金的每份基金份额享有同等分配权;在满足分红条件的前提下,本基金每季度至少分红一次,每年最多分配 12 次,全年分配比例不得低于年度已实现收益的 90%;本基金封闭期内只采取现金分红的方式;封闭期届满后,本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;封闭期届满后,当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额;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,方可进行当期收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金于 2011 年 4 月 1 日进行了收益分配,每 10 份派 0.054 元。本报告期内 2011 年 1 月 10 日已分配数(每 10 份派 0.136 元)为以往年度收益分配。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为 55,221,781.46 元。

5.3 托管人对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

本托管人复核审查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。

§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:南方盛元红利股票型证券投资基金

报告截止日:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	11,483,261.79	79,885,045.33
结算备付金	1,318,529.98	4,877,636.01
存出保证金	1,824,265.68	2,533,414.08
交易性金融资产	2,996,681,189.87	2,955,251,264.56
其中:股票投资	2,830,808,189.87	2,799,547,264.56
基金投资	-	-
债券投资	165,873,000.00	155,704,000.00
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	62,259,157.16	4,183,078.51
应收利息	2,637,285.43	1,559,824.33
应收股利	701,473.08	-
应收申购款	2,153,217.10	978,701.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,079,058,380.09	3,049,268,964.38
负债和所有者权益	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010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	-	-
应付证券清算款	18,590,719.20	32,753,300.80
应付赎回款	1,694,919.01	1,386,582.21
应付管理人报酬	3,600,959.91	3,630,764.12
应付托管费	600,160.00	605,127.33
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,401,900.43	4,298,575.25
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,453,750.16	1,199,642.16
负债合计	27,342,408.71	43,873,991.87
所有者权益:		
实收基金	3,156,756,192.37	2,934,090,661.99
未分配利润	-105,040,220.99	71,304,310.52
所有者权益合计	3,051,715,971.38	3,005,394,972.51
负债和所有者权益总计	3,079,058,380.09	3,049,268,964.38

注:1、报告截止日 2011 年 06 月 30 日,基金份额净值 0.967 元,基金份额总额 3,156,756,192.37 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:南方盛元红利股票型证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入	-101,053,152.77	-755,141,311.93
1.利息收入	1,829,074.38	2,809,609.25
其中:存款利息收入	161,536.91	1,272,486.25
债券利息收入	1,667,537.47	1,077,961.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	459,161.29
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	26,534,577.73	-21,741,797.07
其中:股票投资收益	10,423,771.70	-33,902,985.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	37,950.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	16,072,856.03	12,161,187.96
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-129,553,302.38	-736,364,961.53
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	136,497.50	155,837.42
减:二、费用	31,111,085.93	44,545,313.50
1.管理人报酬	22,093,383.43	25,524,376.47
2.托管费	3,682,230.54	4,254,062.76
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	5,100,447.36	14,534,586.61
5.利息支出	13,855.25	-
其中:卖出回购金融资产支出	13,855.25	-
6.其他费用	221,169.35	232,287.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-132,164,238.70	-799,686,625.43
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-132,164,238.70	-799,686,625.43

注: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:南方盛元红利股票型证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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)	2,934,090,661.99	71,304,310.52	3,005,394,972.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-132,164,238.70	-132,164,238.70
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)	222,665,530.38	11,041,488.65	233,707,019.03
其中:1.基金申购款	608,017,246.77	18,853,691.85	626,870,938.62
2.基金赎回款	-385,351,716.39	-7,812,203.20	-393,163,919.59
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)	-	-55,221,781.46	-55,221,781.46
五、期末所有者权益(基金净值)	3,156,756,192.37	-105,040,220.99	3,051,715,971.38
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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)	3,736,951,159.77	300,091,104.51	4,037,042,264.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-799,686,625.43	-799,686,625.43
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)	-363,261,560.66	927,399.12	-362,334,161.54
其中:1.基金申购款	81,439,095.21	-1,921,939.46	79,517,155.75
2.基金赎回款	-444,700,655.87	2,849,338.58	-441,851,317.29
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)	-	-70,681,941.61	-70,681,941.61
五、期末所有者权益(基金净值)	3,373,689,599.11	-569,350,063.41	2,804,339,535.70

注:后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 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 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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

6.4.4.2 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(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	15,680,019.44	0.46%	518,269,311.46	5.65%
兴业证券	417,672,338.68	12.25%	1,293,225,696.66	14.09%

6.4.5.1.2 债券交易

无

6.4.5.1.3 债券回购交易

无

6.4.5.1.4 权证交易

无

6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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	13,328.27	0.47%	-	-
兴业证券	339,360.59	11.96%	333,369.43	23.78%
关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	440,525.10	5.74%	326,790.87	11.40%
兴业证券	1,050,757.54	13.69%	421,022.67	14.69%

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。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	22,093,383.43	25,524,376.47
其中:支付销售机构的客户维护费	3,695,510.05	4,641,153.91

注:1、本基金已于 2009 年 3 月 23 日转为开放式。

2、转为开放期后,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。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,682,230.54	4,254,062.76

注:支付基金托管人中国建设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。

6.4.5.2.3 销售服务费

无

6.4.5.3 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

本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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	
-	-	-	-	-	-	-	
上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	
中国建设银行	-	-	200,000,000.00	9,095.07	-	-	

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2008 年 3 月 21 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	104,071,500.35	200,071,500.35
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	-	56,000,000.00
期末持有的基金份额	104,071,500.35	144,071,500.35
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.30%	4.27%

6.4.5.4.2 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

6.4.5.5 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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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
中国建设银行	11,483,261.79	122,693.91	471,609,073.12	1,222,642.56

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

6.4.6 期末(2011 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

6.4.6.2 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	
600216	浙江医药	2011年 6 月 27 日	重大事项停牌	31.39	2011年 7 月 4 日	32.60	3,976,402	131,854,819.85	124,819,258.78	-

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券无

§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	2,830,808,189.87	91.94
	其中:股票	2,830,808,189.87	91.94
2	固定收益投资	165,873,000.00	5.39
	其中:债券	165,873,000.00	5.39
	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	12,801,791.77	0.42
6	其他各项资产	69,575,398.45	2.26
7	合计	3,079,058,380.09	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	-	-
B	采掘业	342,779,966.39	11.23
C	制造业	1,847,066,239.76	60.53
C0	食品、饮料	37,805,614.00	1.24
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	108,203,570.96	3.55
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	383,328,975.21	12.56
C7	机械、设备、仪表	1,082,186,190.79	35.46
C8	医药、生物制品	235,541,888.80	7.72
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	51,587,658.96	1.69
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	90,380,580.00	2.96
I	金融、保险业	190,723,945.22	6.25
J	房地产业	209,664,380.46	6.87
K	社会服务业	53,538,044.00	1.75
L	传播与文化产业	45,067,375.08	1.48
M	综合类	-	-
	合计	2,830,808,189.87	92.76

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	600406	国电南瑞	6,656,481	241,630,260.30	7.92
2	000581	威孚高科	4,328,074	166,847,252.70	5.47
3	000400	许继电气	4,598,186	141,670,110.66	4.64
4	600585	海螺水泥	5,090,514	141,312,668.64	4.63
5	600216	浙江医药	3,976,402	124,819,258.78	4.09
6	600395	盘江股份	3,446,081	114,375,428.39	3.75
7	601088	中国神华	3,172,939	95,632,381.46	3.13
8	600739	辽宁成大	3,251,100	90,380,580.00	2.96
9	000937	冀中能源	2,975,336	75,424,767.60	2.47