

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

§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法律责任。

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2012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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告自2012年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, type, start date, manager, and other details.

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“南方积配”。

§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

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for the period and at the end of the period.

§4 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item and Value. Lists the names and roles of the fund manager and custodian.

§5 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

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for the period and at the end of the period.

§6 基金投资组合报告

6.1 基金资产组合
6.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the composition of the fund's assets.

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况
7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fund's investment in different industries.

§8 基金管理人及基金托管人

8.1 基金管理人及基金托管人
8.1.1 基金管理人及其管理基金的情况

Table with 2 columns: Item and Value. Lists the names and roles of the fund manager and custodian.

§9 开放式基金份额变动

9.1 基金份额持有人户数及持有结构
9.2 期末上市基金份额前十名持有人

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the distribution of fund shares among holders.

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

Table with 2 columns: Item and Value. Lists major events related to the fund.

南方积极配置证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

4.7 管理人对于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;本基金每年收益分配次数最多为4次,年度收益分配比例不低于基金年度末实现收益的50%。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
2012年上半年,本基金托管人在对南方积极配置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
2012年上半年,南方积极配置证券投资基金的托管人——南方基金管理有限公司对南方积极配置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、基金费用开支等事项上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各项重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中基金信息内容的真实、准确和完整发表意见
本基金托管人依据对南方基金管理有限公司编制和披露的南方积极配置证券投资基金2012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。

§6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表
资产总计: 1,823,918,580.43
负债和所有者权益: 1,823,918,580.43

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet for the period.

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况
7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fund's investment in different industries.

§8 基金管理人及基金托管人

8.1 基金管理人及基金托管人
8.1.1 基金管理人及其管理基金的情况

Table with 2 columns: Item and Value. Lists the names and roles of the fund manager and custodian.

§9 开放式基金份额变动

9.1 基金份额持有人户数及持有结构
9.2 期末上市基金份额前十名持有人

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the distribution of fund shares among holders.

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

Table with 2 columns: Item and Value. Lists major events related to the fund.

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the balance sheet for the period.

§6.4.1.2 应付关联方的佣金

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the commission payable to related parties.

§6.4.2 关联方报酬

注: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券费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险控制基金后的净额列示。

§6.4.2.1 基金管理费

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the management fees for the period.

§6.4.2.2 基金托管费

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the custody fees for the period.

§6.4.2.3 基金销售服务费

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the sales service fees for the period.

§6.4.2.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the interest income from related parties.

§6.4.2.5 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the value of temporarily suspended stocks.

§6.4.2.6 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况
7.2 期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the fund's investment in different industries.

§7.2 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

Table with 2 columns: Item and Value. Lists the top 10 stocks held by the fund.

§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指期货投资明细

Table with 2 columns: Item and Value. Lists the top 10 futures contracts held by the fund.

§7.4 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

7.4.1 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
7.4.2 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

§7.5 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.5.1 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

§7.6 投资组合报告附注

7.6.1 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的股票

7.6.2 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的债券

7.6.3 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的资产支持证券

7.6.4 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

7.6.5 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

7.6.6 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

7.6.7 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

7.6.8 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

7.6.9 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

7.6.10 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

7.6.11 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

7.6.12 本基金报告期内没有持有被证监会立案调查的其他品种

金额单位:人民币元

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the top 10 stocks held by the fund.

注:卖出包括二级市场主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交均价乘以成交数量)孰低原则,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额
单位:人民币元

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the cost and income from stock transactions.

§7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 2 columns: Item and Value. Shows the bond portfolio at the end of the period.

§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 2 columns: Item and Value. Lists the top 5 bonds held by the fund.

§7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

7.7.1 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.2 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.3 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.4 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.5 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.6 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.7 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.8 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.9 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.10 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.11 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.12 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.13 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.14 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.15 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.16 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.17 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.18 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.19 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.20 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.21 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.22 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.23 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.24 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.25 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.26 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.27 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.28 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.29 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.30 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.31 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.32 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.33 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.34 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.35 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.36 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.37 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.38 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.39 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.40 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.41 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.42 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.43 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.44 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.45 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况

7.7.46 报告期末本基金持有的资产支持证券投资情况