

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:2012年8月29日

§1 重要提示
基金管理人的董事会及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责任。

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仔细阅读本基金的招募说明书。

2.1 基金基本情况
基金简称:南方策略优化股票
基金主代码:202019
信息披露网址:www.nffund.com

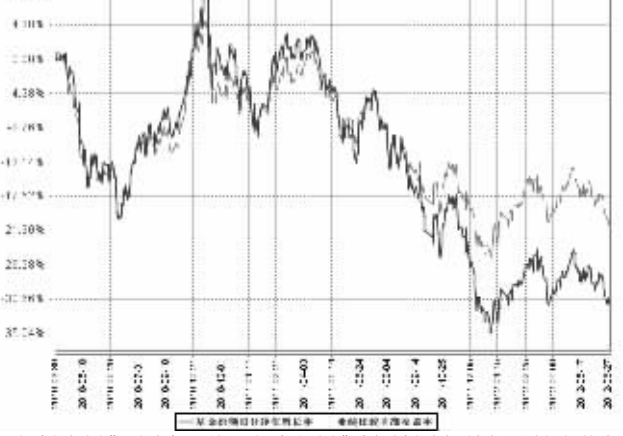
2.2 基金产品说明
本基金通过量化手段优化投资策略,在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

2.3 基金管理人、基金托管人
名称: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
信息披露负责人:姓名:鲍文革

§3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 本期主要财务指标
3.1.1 本期实现收益: -167,690,745.71
3.1.2 期末基金份额净值: 1.029,637,506.17

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, ①-②, ②-④. Rows include 过去一个月, 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 自基金合同生效起至今.

3.2 基金自合同生效以来基金业绩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
基金业绩累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注: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 基金管理人及基金业绩情况
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金字[1998]34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“增资扩股”,注册资本达到1亿元人民币。

4.1.2 基金经理
姓名:刘治平
职务:数量化投资部总经理、基金经理
任职日期:2010年3月16日

4.2 投资策略
本基金在建仓期为基金合同生效之日,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。

4.3 管理人报告
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明
4.3.3 关联交易事项的专项说明

4.4 基金管理人内部控制制度的建设及执行情况
4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
4.4.3 基金管理人内部控制制度的建设及执行情况

南方策略优化股票型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日
6.4.1.1 股票交易
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 关联方名称, 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.

6.4.1.2 债券交易
金额单位:人民币元
关联方名称: 本期, 上期, 本期, 上期

Table with 4 columns: 关联方名称, 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.

6.4.1.3 权证交易
6.4.1.4 应支付关联方的佣金
金额单位:人民币元

6.1 资产负债表
报告截止日:2012年6月30日
单位:人民币元

Table with 3 columns: 资产, 期末, 上年度末. Rows include 货币资金, 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, 交易性金融资产, 应收利息, 其他资产, 资产总计.

Table with 3 columns: 负债和所有者权益, 期末, 上年度末. Rows include 短期借款, 交易性金融负债, 应付利息, 应付债券, 其他负债, 所有者权益合计.

注:报告期期末本基金持仓市值6.83亿元,基金份额净值1.029,637,506.17份。
6.2 利润分配
会计主体:南方策略优化股票型证券投资基金
本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期, 本期, 上期. Rows include 基金合同生效日, 持有的基金份额, 期初持有的基金份额, 期间申购/赎回总份额, 期间拆入/拆出总份额, 期末持有的基金份额, 期末持有的基金份额占基金总资产比例.

注:期间申购/赎回包含红利再投资,申购赎回总份额含转换份额。
6.4.4.2 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

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期, 本期, 上期. Rows include 基金合同生效日, 持有的基金份额, 期初持有的基金份额, 期间申购/赎回总份额, 期间拆入/拆出总份额, 期末持有的基金份额, 期末持有的基金份额占基金总资产比例.

注:基金合同生效以来基金业绩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
基金业绩累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注: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 基金管理人及基金业绩情况
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金字[1998]34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“增资扩股”,注册资本达到1亿元人民币。

4.1.2 基金经理
姓名:刘治平
职务:数量化投资部总经理、基金经理
任职日期:2010年3月16日

4.2 投资策略
本基金在建仓期为基金合同生效之日,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。

4.3 管理人报告
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明
4.3.3 关联交易事项的专项说明

4.4 基金管理人内部控制制度的建设及执行情况
4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
4.4.3 基金管理人内部控制制度的建设及执行情况

Table with 5 columns: 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(%)

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(%)

注:买入包括二级市场主动买入、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(成交金额乘以成交数量)填写,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:卖出包括二级市场主动卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等获得的股票,卖出金额按成交金额(成交金额乘以成交数量)填写,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入股票成本, 卖出股票收入. Rows include 买入股票成本, 卖出股票收入.

注:买入股票成本、卖出股票成本均按照买卖成交金额(成交金额乘以成交数量)填写,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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
金额单位:人民币元

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(%)

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
注:本基金本报告期末持有资产支持证券。

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
注:本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注
7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:无。

§8 基金份额持有人信息
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

Table with 4 columns: 持有户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者. Rows include 持有份额, 占基金份额比例, 持有份额, 占基金份额比例.

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金资产净值比例(%)

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究人员(含基金经理)持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2010年3月03日), 基金份额总额. Rows include 本报告期初基金份额总额, 本报告期基金总申购份额, 本报告期基金总赎回份额, 本报告期基金净申购份额, 本报告期基金份额变动总额.

§10 重大事件揭示
10.1 基金份额持有人大会决议
报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动
报告期内,本基金的基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变
报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1 基金租用证券公司交易单元用于股票投资及佣金支付情况
金额单位:人民币元

Table with 6 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 债券交易, 权证交易. Rows include 股票交易, 债券交易, 权证交易.

注:根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]148号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序:

a. 选择标准
a. 公司经营状况规范,财务状况和经营情况良好;

b. 公司具有较较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

c. 公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

d. 建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B. 选择程序
定期对各券商业务质量从以下几方面进行量化测评,并根据测评的结果选择交易单元,券商的主动性、主要研究报告质量、提供研究报告的态度、协助安排上市公司调研、以及有关专题提供研究报告和沟通;

b. 研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

c. 资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的及时性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利,提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况
金额单位:人民币元

Table with 6 columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易. Rows include 债券交易, 债券回购交易, 权证交易.

债券名称: 成交金额, 占当期债券成交总额的比例, 成交金额, 占当期债券回购成交总额的比例, 成交金额, 占当期权证成交总额的比例

Table with 6 columns: 券商名称, 成交金额, 占当期债券成交总额的比例, 成交金额, 占当期债券回购成交总额的比例, 成交金额, 占当期权证成交总额的比例

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.nffund.com的半年度报告正文。

7.4 报告期内买入股票投资初的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细