

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。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

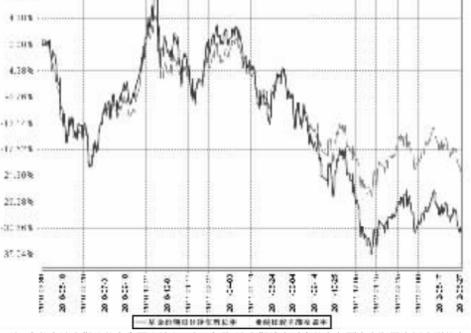
2.2 基金产品说明
本基金通过量化手段优化投资策略,在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

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 本期基金份额净值增长率: 3.02%

Table with 4 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



基金业绩比较基准: 沪深300指数收益率\*60%+上证国债指数收益率\*40%

§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

4.1.2 基金经理 魏基顺 基金经理助理 陈文

4.2 投资策略
4.2.1 资产配置策略
4.2.2 股票投资策略

4.3 风险管理
4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
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
2012年上半年,南方策略优化基金净值增长2.02%,同期沪深300增长4.94%,上证综指增长1.18%。

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

6.4.4.1.1 股票交易
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 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. Rows for 本期 and 上期.

6.4.4.1.2 债券交易
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 成交金额, 占当期债券成交总额的比例, 成交金额, 占当期债券成交总额的比例. Rows for 本期 and 上期.

6.4.4.1.3 权证交易
金额单位:人民币元

6.4.4.1.4 应支付关联方的佣金
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 当期佣金, 占当期佣金总额的比例, 期末应付佣金余额, 占期末应付佣金总额的比例. Rows for 本期 and 上期.

6.4.4.2 基金托管费
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows for 当期发生的基金托管费, 其中:支付销售机构的客户维护费.

6.4.4.2.1 基金托管费
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows for 当期发生的基金托管费.

6.4.4.2.2 基金托管费
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows for 当期发生的基金托管费.

6.4.4.2.3 销售服务费
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows for 当期发生的基金托管费.

6.4.4.2.4 其他关联方投资本基金的情况
6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table with 4 columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间. Rows for 基金合同生效日, 期初持有的基金份额, 期末持有的基金份额.

6.4.4.4.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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(%)

7.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

Table with 7 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(%)

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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

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(%)

7.4 报告期内买入股票超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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(%)

7.5 报告期内卖出股票超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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(%)

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序的前十名资产支持证券投资明细
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(%)

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(%)

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, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

7.4.3 买入股票成本总额及卖出股票的收入总额
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.5 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 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序的前十名资产支持证券投资明细
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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没有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。

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额

7.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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(%)

7.9.3 期末其他各项资产构成
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额

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 5 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
7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

§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

Table with 5 columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例

§9 开放式基金份额变动
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金总份额比例

§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

10.4 基金投资策略的改变

10.5 基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期佣金总额的比例

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. 公司经营状况良好,财务状况及经营业绩良好;

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. 公司内部管理制度规范,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
定期对各券商服务质量从以下几方面进行量化评价,并根据评价的结果选择交易单元:

a. 券商的主动性; b. 主要研究报告质量; c. 及时提供所提供服务; d. 协助安排上市公司调研; e. 以及其他有关专题提供研究报告和沟通;

f. 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;

g. 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 5 columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

Table with 5 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