南方稳健成长证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

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
送出日期:2013年8月27日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方稳健成长证券投资基金
基金简称	南方稳健成长混合
基金主代码	202001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2001年9月28日
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
报告期末基金份额总额	4,638,480,681.58份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为稳健成长型基金,在控制风险并保持基金投资组合良好流动性的前提下,力求为投资者提供长期稳定的资本利得。
投资策略	本基金秉承价值投资和稳健投资的理念,通过深入的调查研究,挖掘上市公司的价值,寻求价值被低估的证券,采取低风险适度收益的配比原则,通过科学的组合投资,降低投资风险,以中长期投资为主,追求基金资产的长期稳定增值。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	赵会军
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	110,249,233.69
本期利润	-11,813,757.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0025
本期基金份额净值增长率	-0.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2020
期末基金资产净值	3,701,407,121.75
期末基金份额净值	0.7980

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)。

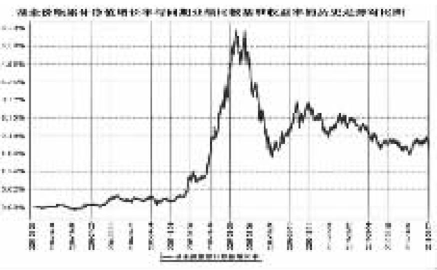
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-7.08%	1.46%	-	-	-7.08%	1.46%
过去三个月	-1.94%	1.07%	-	-	-1.94%	1.07%
过去六个月	-0.47%	1.07%	-	-	-0.47%	1.07%
过去一年	-2.64%	0.95%	-	-	-2.64%	0.95%
过去三年	-7.74%	0.97%	-	-	-7.74%	0.97%
自基金合同生效起至今	177.10%	1.23%	-	-	177.10%	1.23%

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



§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%。公司在北京、上海、合肥等地设有分公司,在香港设有子公司——南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末,公司管理资产规模超过2,000亿元,旗下管理42只开放式基金,1只封闭式基金,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		
李源海	本基金基金经理、投资部副总监	2010年7月15日	-	12	管理学博士,具有基金从业资格。曾任职于中国银行深圳分行、湘财证券有限责任公司投资银行部及证券投资部;2002年起进入基金行业,历任万家基金管理有限公司(原天同基金管理有限公司)研究部高级经理、基金管理部基金经理;2004年9月至2005年10月任万家增强收益债券型证券投资基金(原天同保本增值证券投资基金)基金经理;2006年7月至2007年7月任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理;2006年2月至2009年8月,任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理;2008年7月至2009年8月,任申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金经理。2009年8月,加入南方基金,任职于产品开发部;2010年1月至今,担任南方基金投资部副总监、南方积配基金经理;2010年7月至今,任南方稳健、南稳贰号基金经理。
马北雁	本基金基金经理	2008年4月11日	-	12	土壤学博士,具有基金从业资格。曾先后担任广东省科学院助理研究员、平安证券研究所农业和食品饮料行业研究员、平安证券综合研究所行业公司部副总经理等职务。2005年9月加入南方基金,2008年4月至今,任南方稳健基金经理;2008年4月至今,任南稳贰号基金经理。
应帅	本基金基金经理	2012年11月23日	-	12	北大光华管理学院管理学硕士,具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员,2007年加入南方基金,2007年5月至2009年2月,任南方宝元基金经理;2007年5月至2012年11月,任南方成份基金经理;2010年12月至今,任南方宝元基金经理;2012年11月至今,任南方稳健基金经理;2012年11月至今,任南稳贰号基金经理。
蔡望鹏	本基金的基金经理助理	2013年6月20日		5	清华大学硕士,具有基金从业资格;曾担任博时基金研究员;2013年2月加入南方基金,担任研究部行业研究员;2013年6月至今,任南方稳健、南稳贰号基金经理助理。

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,除首任基金经理外,"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、《南方稳健成长证券投资基金合同》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 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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次, 是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

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

2013年年初开始,大盘股延续去年12月份的走势继续冲高,但很快见顶回落。而与此同时,小盘股则出现了猛烈的上涨。整个上半年的风格是代表传统产业的大股票快速回落,而以电子、传媒、环保为代表的新兴产业板块则出现了加速上涨的势头,而且出现了板块效应快速扩散的趋势,存在一定的脱离基本面的风险。上半年沪深300指数下跌12.78%,而创业板指数则背道而驰急速上涨41.72%。由于政策对于金融地产的不确定性以及宏观经济出现了下行的势头,本基金减少了金融地产以及汽车的配置,而是加大了普通大众消费品的配置,因为其有稳定增长的特性兼估值比较合理(相对于高估值的电子、环保、传媒)。同时加大了医药板块的配置。在新兴产业方面,则更为看好智慧城市和环保产业。仓位方面,本基金继续维持过往较为稳定的风格,未作调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年上半年沪深300指数增长率为-12.78%,本基金净值增长率为-0.47 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济增长比预料中要更为疲弱,而且经济刺激政策更为稳健和保守,在稳增长的同时更为强调经济转型。因此预计2013年全年经济继续保持疲软,增速有下一台阶的风险。而大规模的刺激政策以及宽松的货币政策皆不可预期,因此证券市场料以震荡下行为主,机会均在于结构性以及个股。总体而言,本基金预计2013下半年证券市场并不乐观,在市场结构方面,强周期品种如煤炭有色仍将保持谨慎,看好稳定增长类如医药、食品饮料以及低估值品种金融地产。

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:基金收益分配比例按有关规定制定;投资者可以选择现金分红方式或分红再投资的分红方式,以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准,投资者选择分红的默认方式为现金分红;基金投资当年亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次,但若成立不满3个月则不进行收益分配,年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成;基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值;每一基金单位享有同等分配权。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况, 本报告期本基金不符合基金合同约定的收益分配条件,未有收益分配事项。

§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

本报告期内,本基金托管人在对南方稳健成长混合型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

本报告期内,南方稳健成长混合型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方稳健成长混合型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、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,南方稳健成长混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方稳健成长混合型证券投资基金2013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

会计主体:南方稳健成长证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	56,495,060.30	89,800,222.75
结算备付金	3,213,617.08	1,442,997.77
存出保证金	1,168,169.80	1,825,915.71
交易性金融资产	3,632,495,823.27	3,727,278,842.80
其中:股票投资	2,764,058,665.85	2,912,049,331.40
基金投资	-	-
债券投资	868,437,157.42	815,229,511.40
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	35,000,000.00	100,000,000.00
应收证券清算款	1,910,000.00	17,953,672.44
应收利息	17,924,609.82	5,201,438.37
应收股利	674,371.56	-
应收申购款	370,373.15	195,044.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,749,252,024.98	3,943,698,133.87
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	35,449,433.88	31,524,789.30
应付赎回款	1,734,741.38	3,186,263.27
应付管理人报酬	4,719,304.04	4,659,255.50
应付托管费	786,550.64	776,542.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,448,976.70	2,497,452.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	705,896.59	1,168,508.45
负债合计	47,844,903.23	43,812,811.22
所有者权益:		
实收基金	4,638,480,681.58	4,864,087,401.57
未分配利润	-937,073,559.83	-964,202,078.92
所有者权益合计	3,701,407,121.75	3,899,885,322.65
负债和所有者权益总计	3,749,252,024.98	3,943,698,133.87

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.8369元,基金份额总额4,602,415,011.05份。

6.2 利润表

会计主体:南方稳健成长证券投资基金

本报告期: 2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	29,346,462.07	104,245,611.92
1.利息收入	15,754,175.76	17,527,426.76
其中:存款利息收入	436,693.20	1,041,290.25
债券利息收入	14,954,260.66	16,064,303.45
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	363,221.90	421,833.06
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	135,350,176.63	-287,376,860.63
其中:股票投资收益	96,463,908.94	-306,818,772.06
基金投资收益	-	-
债券投资收益	12,485.22	1,738,313.81
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	38,873,782.47	17,703,597.62
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-122,062,991.39	373,886,287.18
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	305,101.07	208,758.61
减:二、费用	41,160,219.77	41,617,400.77
1.管理人报酬	29,158,433.08	30,821,446.92
2.托管费	4,859,738.79	5,136,907.90
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	6,935,673.02	5,443,942.56
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	206,374.88	215,103.39
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-11,813,757.70	62,628,211.15
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-11,813,757.70	62,628,211.15

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方稳健成长证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	4,864,087,401.57	-964,202,078.92	3,899,885,322.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,813,757.70	-11,813,757.70
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)	-225,606,719.99	38,942,276.79	-186,664,443.20
其中:1.基金申购款	69,825,592.74	-12,441,334.94	57,384,257.80
2.基金赎回款	-295,432,312.73	51,383,611.73	-244,048,701.00
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,638,480,681.58	-937,073,559.83	3,701,407,121.75
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	5,106,558,480.80	-982,899,329.48	4,123,659,151.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	62,628,211.15	62,628,211.15
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)	-112,999,322.38	19,530,394.03	-93,468,928.35
其中:1.基金申购款	89,949,642.59	-16,833,739.51	73,115,903.08
2.基金赎回款	-202,948,964.97	36,364,133.54	-166,584,831.43
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,993,559,158.42	-900,740,724.30	4,092,818,434.12

报表附注为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:

杨小松	邓见梁	邓见梁
基金管理人负责人	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 重要会计政策和会计估计

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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。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、红利时代扣代缴个人所得税,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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("南方基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	402,128,629.54	8.88%	79,313,428.89	2.23%
华泰联合证券	-	-	-	-

注:报告期内未通过关联方进行债券、回购交易。

6.4.5.1.2 权证交易

无。

6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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	355,844.50	8.76%	355165.72	7.98%-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	66,489.90	2.23%	49,580.30	1.97%
华泰联合证券	-	-	-	-

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	29,158,433.08	30,821,446.92
其中:支付销售机构的客户维护费	418,492.19	420,536.04

注:支付基金管理人南方基金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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,859,738.79	5,136,907.90

注:支付基金托管人中国工商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。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无

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

注:无

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

注: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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国工商银行	56,495,060.30	392,714.33	186,650,842.71	1,015,712.35

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

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。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 期末(2013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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600578	京能热电	2013年4月2日	2014年3月28日	非公开发行流通受限	6.92	6.92	5,000,000	34,600,000.00	34,600,000.00	-
600509	天富热电	2013年3月21日	2014年3月18日	非公开发行流通受限	7.55	7.82	3,400,000	25,670,000.00	26,588,000.00	-
600098	广州发展	2012年7月4日	2013年7月2日	非公开发行流通受限	6.42	5.04	2,500,000	16,050,000.00	12,600,000.00	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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	备注
300020	银江股份	2013年6月3日	重大事项停牌	22.67	-	-	120,000.00	2,227,359.00	2,720,400.00	-

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	2,764,058,665.85	73.72
	其中:股票	2,764,058,665.85	73.72
2	固定收益投资	868,437,157.42	23.16
	其中:债券	868,437,157.42	23.16
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	35,000,000.00	0.93
	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	59,708,677.38	1.59
6	其他各项资产	22,047,524.33	0.59
7	合计	3,749,252,024.98	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,441,305,403.03	38.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,317,584.08	2.22
E	建筑业	21,020,596.74	0.57
F	批发和零售业	19,782,322.75	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	86,485,883.22	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	163,944,354.44	4.43
J	金融业	339,180,413.71	9.16
K	房地产业	320,553,110.67	8.66
L	租赁和商务服务业	168,000.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	11,560.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	205,318,559.23	5.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	53,402,877.66	1.44
S	综合	30,568,000.32	0.83
	合计	2,764,058,665.85	74.68

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	000895	双汇发展	4,433,696	170,431,274.24	4.60
2	600000	浦发银行	19,361,000	160,309,080.00	4.33
3	002415	海康威视	3,900,388	137,839,711.92	3.72
4	600518	康美药业	7,073,569	136,024,731.87	3.67
5	600519	贵州茅台	610,671	117,474,780.27	3.17
6	600406	国电南瑞	7,474,394	111,592,702.42	3.01
7	000826	桑德环境	3,366,227	108,628,145.29	2.93
8	600594	益佰制药	3,325,740	102,798,623.40	2.78
9	000002	万科A	10,423,337	102,669,869.45	2.77
10	601318	中国平安	2,751,344	95,636,717.44	2.58

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 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位:人民币元

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(%)
1	600000	浦发银行	163,373,849.68	4.19
2	002422	科伦药业	117,442,897.62	3.01
3	601006	大秦铁路	111,969,021.54	2.87
4	002415	海康威视	110,908,896.08	2.84
5	600887	伊利股份	91,002,767.28	2.33
6	600030	中信证券	79,672,867.40	2.04
7	600518	XD康美药	70,726,004.89	1.81
8	000527	美的电器	66,576,848.03	1.71
9	000826	桑德环境	64,979,755.04	1.67
10	300083	劲胜股份	60,139,309.77	1.54
11	002081	金螳螂	60,106,521.88	1.54
12	300128	锦富新材	53,482,307.60	1.37
13	600362	江西铜业	51,190,450.58	1.31
14	601928	凤凰传媒	50,638,495.63	1.30
15	000100	TCL集团	48,781,740.28	1.25
16	600098	广州发展	48,305,145.99	1.24
17	600315	上海家化	47,305,943.48	1.21
18	600261	阳光照明	42,312,974.38	1.08
19	300273	和佳股份	42,288,069.25	1.08
20	000656	金科股份	40,286,142.66	1.03

注:买入包括二级市场上主动的买入、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(成交单价乘以成交数量)填列,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

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(%)
1	000858	五粮液	140,088,161.45	3.59
2	000001	平安银行	135,131,209.48	3.47
3	002081	金螳螂	120,921,097.76	3.10
4	002422	科伦药业	109,817,395.02	2.82
5	601668	中国建筑	92,682,039.14	2.38
6	600036	招商银行	83,493,766.16	2.14
7	600519	贵州茅台	75,696,546.28	1.94
8	000002	万科A	73,661,134.93	1.89
9	600837	海通证券	70,699,302.56	1.81
10	000895	双汇发展	69,173,487.70	1.77
11	600030	中信证券	65,607,615.94	1.68
12	600104	上汽集团	62,527,008.81	1.60
13	000069	华侨城A	61,408,010.72	1.57
14	300128	锦富新材	60,367,869.41	1.55
15	000651	格力电器	55,382,407.21	1.42
16	600362	江西铜业	48,824,204.38	1.25
17	300083	劲胜股份	46,867,503.45	1.20
18	000783	长江证券	43,912,173.28	1.13
19	002308	威创股份	42,129,263.44	1.08
20	600406	国电南瑞	40,540,954.88	1.04

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、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(成交单价乘以成交数量)填列,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

买入股票成本(成交)总额	2,235,560,002.32
卖出股票收入(成交)总额	2,352,729,622.55

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	17,119,157.42	0.46
2	央行票据	49,945,000.00	1.35
3	金融债券	801,373,000.00	21.65
	其中:政策性金融债	801,373,000.00	21.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	868,437,157.42	23.46

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

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(%)
1	080220	08国开20	5,000,000	483,850,000.00	13.07
2	120245	12国开45	700,000	69,629,000.00	1.88
3	1001060	10央票60	500,000	49,945,000.00	1.35
4	130201	13国开01	500,000	49,725,000.00	1.34
5	050224	05国开24	500,000	49,225,000.00	1.33

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,168,169.80
2	应收证券清算款	1,910,000.00
3	应收股利	674,371.56
4	应收利息	17,924,609.82
5	应收申购款	370,373.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,047,524.33

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 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。

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
259,871	17,849.17	26,327,638.57	0.57%	4,612,153,043.01	99.43%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	166,349.38	0.0036%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2001年9月28日)基金份额总额	3,488,938,200.00
本报告期期初基金份额总额	4,864,087,401.57
本报告期基金总申购份额	69,825,592.74
减:本报告期基金总赎回份额	295,432,312.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,638,480,681.58

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无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

经中国证监会基金部【2013】13号文函复,基金管理人于2013年1月5日发布公告,自2013年1月1日起,高良玉不再担任公司总经理职务,由董事长吴万善代为履行公司总经理职务。

经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1087号文核准,基金管理人于2013年8月22日发布公告,自2013年8月22日起,杨小松转任公司总经理职务,不再担任公司督察长职务;由鲍文革担任公司督察长职务。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,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

本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

本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

因基金管理人管理的南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金("开元300ETF")在集中申购期超过沪深300指数自然权重大比例接受停牌的永泰能源股票换购,然后在建仓期大比例卖出超过沪深300自然权重的部分股票,致使基金资产受到较大损失,2013年4月19日中国证监会向公司下发了《关于对南方基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》(【2013】18号)的行政监管措施决定书,认为基金管理人在开元300ETF投资过程中未能履行谨慎勤勉义务,内部控制方面存在内部控制制度建设薄弱,缺乏ETF募集期股票换购的相关制度规定;合规及风控管理未能覆盖ETF基金投资环节;关于永泰能源的相关决策未能留痕等。鉴于上述情况,按照《证券投资基金管理公司管理办法》第七十五条的规定,中国证监会责令公司进行为期3个月的整改,在整改期间暂停受理和审核公司所有新产品和新业务申请。

基金管理人于2013年4月24日发布了《南方开元沪深300ETF基金持有人补偿公告》,对开元300ETF超比例接受永泰能源股票换购给相关基金份额持有人造成的经济损失进行了补偿, 实际补偿金额为47,996,008.62元。

同时, 基金管理人就公司内部管理、合规及风险控制制度建设、ETF募集及投资管理程序方面的问题进行了一一整改, 并向中国证监会及其深圳监管局提交了整改报告, 目前已完成整改工作、经监管部门现场检查并验收合格。

除上述情况外,本报告期内,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进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	710,946,527.62	15.70%	629,116.69	15.49%	-
山西证券	1	617,714,567.53	13.64%	562,368.44	13.84%	-
财达证券	1	558,394,366.00	12.33%	508,360.37	12.51%	-
申银万国	1	518,093,994.27	11.44%	458,421.21	11.29%	-
长城证券	1	479,451,100.63	10.59%	436,490.57	10.75%	-
华泰证券	1	402,128,629.54	8.88%	355,844.50	8.76%	-
国泰君安	1	284,475,856.70	6.28%	251,732.46	6.20%	-
齐鲁证券	1	232,072,585.91	5.13%	205,361.67	5.06%	-
中信证券	2	212,402,216.80	4.69%	187,955.24	4.63%	-
华林证券	1	204,053,803.69	4.51%	185,770.04	4.57%	-
海通证券	1	168,757,398.85	3.73%	153,636.05	3.78%	-
东方证券	1	122,515,627.95	2.71%	111,538.50	2.75%	-
国金证券	1	17,012,949.38	0.38%	15,488.63	0.38%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
招商证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	120,000,000.00	30.00%	-	-
申银万国	2,063,452.07	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	200,000,000.00	50.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	80,000,000.00	20.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

注:交易单元的选择标准和程序

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]48号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司专用交易席位的选择标准和程序:

A:选择标准

(a)公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;

(b)公司具有较强的研究能力,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:选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

(a)服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

(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时效性、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。