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:2013年3月29日

南方盛元红利股票型证券投资基金

【2012】年度报告摘要

§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2013年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31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	3,001,747,421.54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,以及高信息国定收益类投资品种。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	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-370,271,253.80	-287,655,334.94	-2,769,750.52
本期利润	216,157,128.07	-983,440,787.30	-84,942,870.60
加权平均基金份额本期利润	0.0674	-0.3136	-0.0256
本期基金份额净值增长率	10.47%	-29.67%	-1.39%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2189	-0.2928	0.0151
期末基金资产净值	2,344,801,893.68	2,257,828,134.52	3,005,394,972.51
期末基金份额净值	0.781	0.707	1.024

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

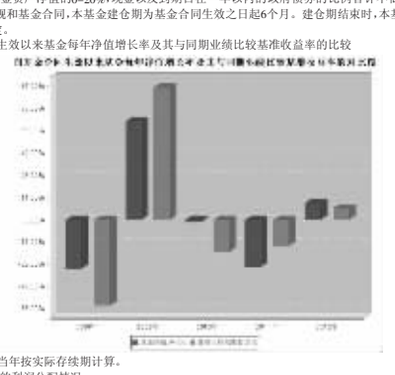
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.40%	1.19%	11.90%	1.08%	-5.50%	0.11%
过去六个月	1.69%	1.20%	6.11%	1.02%	-4.42%	0.18%
过去一年	10.47%	1.30%	6.84%	1.03%	3.63%	0.27%
过去三年	-23.39%	1.39%	-28.46%	1.14%	5.07%	0.25%
自基金合同生效起至今	-14.00%	1.49%	-40.07%	1.74%	26.07%	-0.25%

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:基金合同生效当年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	0.1900	43,435,032.58	11,786,748.88	55,221,781.46	
2010	0.4000	101,787,112.54	24,762,249.71	126,549,362.25	
合计	0.5900	145,222,145.12	36,548,998.59	181,771,143.71	

§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会字〔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会字〔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,公司管理资产规模近2,300亿元,旗下管理37只开放式基金,2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		
蒋峰	本基金的基金经理	2010年10月16日	2012年12月14日	11	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2012年12月,任南方恒元基金经理;2010年10月至2012年12月,任南方盛元基金经理;2011年6月至2012年12月,任南方保本基金经理。
张旭	本基金的基金经理	2012年11月23日	-	4年	毕业于中央财经大学,获金融学硕士学位,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2008年加入南方基金,曾任金融及地产行业研究员、高级策略研究员、南方盛元基金经理助理;2012年3月至今,任南方消费基金经理;2012年11月至今,任南方盛元基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场中购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,制定了研究报告审核流程,股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资决策委员会议事规则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在,并且交易占优比也没有明显异常,不存在不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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。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17次。其中,14次是由于指数型基金根据标的指数成份股调整而被动调仓所致;2次是由于基金接受投资者大额申赎后,被动增减仓位或组合配置所致;1次是由于社保201组合调整,选择期限与收益匹配较好的债券进行投资的需要。

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

中国经济在经历了两年半的下行周期后,于2012年下半年逐渐触底企稳,全年通胀水平温和回落,CPI从2011年中期的6%以上的水平回落至2012年底的2%附近,较好的实现了经济软着陆。政策方面,四季度胜利召开了党的十八大会议,新股IPO暂停,新增境外资金进场,较为集中的利好股市政策引爆了A股压抑已久的做多热情,年底出现了近两年来最为快速而坚决的反弹行情。

受益于12月份的大幅上涨,A股市场全年整体以阳线报收,结束了连续两年下跌的局面。报告期内沪深300上涨7.55%,走势上大致走出了N字形,整体呈窄幅震荡格局。从行业表现来看,低估值的地产、金融以及成长性稳定的医药等行业涨幅领先,而电力设备、通信、煤炭等板块跌幅较大。

全年来看,本基金保持了较高权益类资产的仓位,按照上游看资源的稀缺性、中游看门槛高度、下游看品牌强度的基本思路选择优势上市公司,坚持买入持有的策略。阶段性的重点配置了地产金融、上游资源、寡头制造以及白酒等行业,取得了一定的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为0.781元,2012年度的份额净值增长率为10.47%,同期沪深300涨幅7.55 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段,我们认为:1、国内宏观经济弱复苏格局确立,去年四季度或是经济阶段性底部,这也是吸引新增资金的重要前提。2、上半年通胀压力较小,有条件提供一个相对宽松的货币政策环境,实施部分要素价格改革。3、国际方面,欧美经济的复苏、日元主动大幅贬值推动全球风险资产偏好提高,这也为A股提供了较为有利的外部环境,然而我们密切关注的风险是美国退出宽松政策,进而引发资本从新兴经济体退出,回流发达国家本土。

对2013年的A股市场,我们相对乐观,主要原因包括:一是从投资时钟角度看,经济复苏、温和通胀和适度宽松的货币政策是股票类资产较为理想的投资窗口,较债券、现金、大宗商品等其他类资产更具吸引力;二是从全球资金配置的角度,A股部分板块已经具有了投资价值的比较优势;三是纵向与A股历史对比,目前估值水平仍处于历史底部区域,大致与2005年、2008年股市低点时相当;四是部分行业盈利能力出现复苏迹象。然而,2013市场涨幅或远不能与2006年-2007年,和2009年的大牛市相媲美,主要原因是前两轮牛市都是经济基本面叠加了十分有利的政策环境,前者有股改红利,后者有全球协同一致的大规模经济刺激,而目前的经济弱复苏格局,在没有进一步推动力的情况下,A股尚不具备与前两轮牛市媲美的条件,上涨也不会一蹴而就,因此,整体涨幅空间和行业轮动规律会有所差异。

落实到投资策略上,我们比较看好的配置领域包括:仍具有估值修复空间的金融、地产;竞争格局良好的寡头制造业;具有品牌定价权的消费品;改革红利释放领域,如城镇化、环保等。本基金将根据对宏观经济、市场趋势和结构的综合判断,动态调整组合,争取为基金持有人创造有竞争力的风险调整后回报。

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,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,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,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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 审计报告

本基金2012年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2013)第20023号“标准无保留意见的审计报告”,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1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:2012年12月31日

单位:人民币元

姓名	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	119,598,786.78	135,411,019.29
结算备付金	413,644.27	2,014,137.25
存出保证金	1,593,472.41	1,557,572.79
交易性金融资产	2,234,446,564.43	2,141,991,411.50
其中:股票投资	2,194,466,564.43	2,123,132,411.50
基金投资	-	-
债券投资	39,980,000.00	18,859,000.00
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	20,493,940.97	-
应收利息	733,389.66	308,307.86
应收股利	-	-
应收申购款	116,357.46	121,188.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,377,396,155.98	2,281,403,636.81
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	25,443,982.31	17,175,285.53
应付赎回款	1,538,396.30	296,720.25
应付管理人报酬	2,740,553.23	2,981,683.62
应付托管费	456,758.89	496,947.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	517,131.45	981,144.06
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,897,440.12	1,643,721.56
负债合计	32,594,262.30	23,575,502.29
所有者权益:		
实收基金	3,001,747,421.54	3,192,586,026.15
未分配利润	-656,945,527.86	-934,757,891.63
所有者权益合计	2,344,801,893.68	2,257,828,134.52
负债和所有者权益总计	2,377,396,155.98	2,281,403,636.81

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.781元,基金份额总额3,001,747,421.54份。

7.2 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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	267,697,637.47	-923,489,398.26
1.利息收入	4,082,424.40	3,292,951.21
其中:存款利息收入	399,123.45	562,190.24
债券利息收入	3,683,300.95	2,730,760.97
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-323,073,561.75	-231,298,840.51
其中:股票投资收益	-350,692,681.49	-257,316,820.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	34,979.45	456,370.26
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	27,584,140.29	25,561,609.87
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	586,428,381.87	-695,785,452.36
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	260,392.95	301,943.40
减:二、费用	51,540,509.40	59,951,389.04
1.管理人报酬	36,114,732.05	42,948,747.69
2.托管费	6,019,122.08	7,158,124.59
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	8,976,833.82	9,384,217.90
5.利息支出	-	25,506.96
其中:卖出回购金融资产支出	-	25,506.96
6.其他费用	429,821.45	434,791.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	216,157,128.07	-983,440,787.30
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	216,157,128.07	-983,440,787.30

7.3 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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31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)	3,192,586,026.15	-934,757,891.63	2,257,828,134.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	216,157,128.07	216,157,128.07
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)	-190,838,604.61	61,655,235.70	-129,183,368.91
其中:1.基金申购款	363,974,428.07	-77,830,945.06	286,143,483.01
2.基金赎回款	-554,813,032.68	139,486,180.76	-415,326,851.92
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)	3,001,747,421.54	-656,945,527.86	2,344,801,893.68
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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(本期净利润)	-	-983,440,787.30	-983,440,787.30
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)	258,495,364.16	32,600,366.61	291,095,730.77
其中:1.基金申购款	890,033,791.53	5,725,455.63	895,759,247.16
2.基金赎回款	-631,538,427.37	26,874,910.98	-604,663,516.39
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)	3,192,586,026.15	-934,757,891.63	2,257,828,134.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____吴万善_____ _____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

7.4 报表附注

7.4.1 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与最近一期年度报告完全一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

项目	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
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	94,187,798.99	1.62%	15,680,019.44	0.25%
兴业证券	913,463,659.51	15.68%	630,850,902.74	10.09%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31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	85,748.06	1.73%	-	-
兴业证券	755,821.58	15.22%	98,040.12	18.96%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	0.26%	-	-
兴业证券	512,569.26	9.83%	173,208.67	17.65%

注:1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,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的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	36,114,732.05	42,948,747.69
其中:支付销售机构的客户维护费	5,336,138.95	6,825,931.34

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,019,122.08	7,158,124.59

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。

7.4.4.2.3 销售服务费

无。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	104,071,500.35
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	45,265,000.00	-
期末持有的基金份额	58,806,500.35	104,071,500.35
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.96%	3.26%

7.4.4.4.2 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

无。

7.4.4.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	119,598,786.78	357,790.32	135,411,019.29	456,997.62

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 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

7.4.5.1.1 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
002051	中工国际	2012年12月26日	2013年12月28日	非公开发行	20.22	20.37	1,484,900	30,024,678.00	30,247,413.00	-
600216	浙江医药	2012年8月28日	2013年8月24日	非公开发行	18.33	19.31	1,500,000	27,495,000.00	28,965,000.00	-
002241	歌尔声学	2012年4月11日	2013年4月12日	非公开发行	24.69	34.33	700,000	17,283,000.00	24,031,000.00	-

注:基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《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,我公司制定了相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交易单元:

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。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§8 投资组合报告

8.1 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	2,194,466,564.43	92.31
	其中:股票	2,194,466,564.43	92.31
2	固定收益投资	39,980,000.00	1.68
	其中:债券	39,980,000.00	1.68
	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	120,012,431.05	5.05
6	其他各项资产	22,937,160.50	0.96
7	合计	2,377,396,155.98	100.00

8.2 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	97,984,651.50	4.18
C	制造业	1,042,800,197.34	44.47
C0	食品、饮料	369,654,253.30	15.76
C1	纺织、服装、皮毛	44,501,488.66	1.90
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,490,000.00	0.62
C5	电子	24,031,000.00	1.02
C6	金属、非金属	36,900,000.00	1.57
C7	机械、设备、仪表	352,785,274.22	15.05
C8	医药、生物制品	129,935,702.64	5.54
C99	其他制造业	70,502,478.52	3.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	18,023,701.77	0.77
E	建筑业	58,152,811.96	2.48
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	185,362,279.83	7.91
H	批发和零售贸易	17,170,391.34	0.73
I	金融、保险业	239,467,540.97	10.21
J	房地产业	377,372,457.66	16.09
K	社会服务业	158,132,532.06	6.74
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,194,466,564.43	93.59

8.3 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