

南方高增长证券投资基金

2013 半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2013年8月27日

重要提示

1.1 重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。

基金简介

2.1 基金基本情况
基金名称:南方高增长股票(LOF)
基金代码:160106
基金运作方式:上市契约型开放式(LOF)

基金的投资过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,亦未发现基金经理有违反《证券投资基金法》的行为。

5.2 托管人对本报告期内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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现基金管理人存在有损基金份额持有人利益的行为。

6.1 资产负债表
资产负债表:南方高增长证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日
单位:人民币元

Table with columns: 资产, 负债和所有者权益. Rows include 货币资金, 交易性金融资产, 应收利息, etc.

6.2 利润表
利润表:南方高增长证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润总额, etc.

6.3 所有者权益变动表
所有者权益变动表:南方高增长证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动, etc.

6.4 管理人报告
6.4.1 基金管理人及基金经理情况
6.4.2 基金管理人及基金经理的经验
6.4.3 基金管理人及基金经理的从业经历

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, etc.

6.5 投资组合报告
6.5.1 报告期末基金资产组合情况
6.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, etc.

6.5.3 报告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
6.5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

6.5.5 报告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
6.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

6.5.7 投资组合报告附注
6.5.7.1 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于发行主体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、处罚的股票。

6.5.7.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于涉及重大资产重组的股票。

6.5.7.3 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被控股股东、实际控制人或者其关联方违规占用资金或者有其他重大关联交易的股票。

6.5.7.4 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为欺诈发行、虚假发行的股票。

6.5.7.5 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为内幕交易、涉嫌操纵市场的股票。

6.5.7.6 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为违法违规披露、操纵市场等违法违规的发行人的股票。

6.5.7.7 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为欺诈发行、虚假发行的股票。

6.5.7.8 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为内幕交易、涉嫌操纵市场的股票。

6.5.7.9 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为违法违规披露、操纵市场等违法违规的发行人的股票。

6.5.7.10 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为欺诈发行、虚假发行的股票。

6.5.7.11 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为内幕交易、涉嫌操纵市场的股票。

6.5.7.12 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为违法违规披露、操纵市场等违法违规的发行人的股票。

6.5.7.13 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为欺诈发行、虚假发行的股票。

6.5.7.14 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为内幕交易、涉嫌操纵市场的股票。

6.5.7.15 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为违法违规披露、操纵市场等违法违规的发行人的股票。

6.5.7.16 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为欺诈发行、虚假发行的股票。

6.5.7.17 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为内幕交易、涉嫌操纵市场的股票。

6.5.7.18 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为违法违规披露、操纵市场等违法违规的发行人的股票。

6.5.7.19 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为欺诈发行、虚假发行的股票。

6.5.7.20 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为内幕交易、涉嫌操纵市场的股票。

6.5.7.21 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为违法违规披露、操纵市场等违法违规的发行人的股票。

6.5.7.22 报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于被中国证监会认定为欺诈发行、虚假发行的股票。

当期发生的基金应支付的管理费
2,947,800.42
23,766,099.03

当期发生的基金应支付的托管费
24,987,964.84
2,753,170.88

6.4.5.2 基金托管费
基金托管费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:
日托管费=前一日基金资产净值 X 1.5% / 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
6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.5.4.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table with columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 基金买入, 基金卖出, 交易金额, etc.

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
6.4.5.4.3 由关联方担保的银行存款余额及当期产生的利息收入

6.4.5.5 其他关联方交易事项的说明
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 因新增发债及证券发行于期末持有的流通受限证券
6.4.6.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
6.4.6.3 期末持有的资产支持证券明细

6.4.6.4 期末持有的股指期货合约
6.4.6.5 期末持有的国债期货合约

6.4.6.6 期末持有的权证
6.4.6.7 期末持有的其他金融工具

6.4.6.8 期末持有的其他金融工具
6.4.6.9 期末持有的其他金融工具

6.4.6.10 期末持有的其他金融工具
6.4.6.11 期末持有的其他金融工具

6.4.6.12 期末持有的其他金融工具
6.4.6.13 期末持有的其他金融工具

6.4.6.14 期末持有的其他金融工具
6.4.6.15 期末持有的其他金融工具

6.4.6.16 期末持有的其他金融工具
6.4.6.17 期末持有的其他金融工具

6.4.6.18 期末持有的其他金融工具
6.4.6.19 期末持有的其他金融工具

6.4.6.20 期末持有的其他金融工具
6.4.6.21 期末持有的其他金融工具

6.4.6.22 期末持有的其他金融工具
6.4.6.23 期末持有的其他金融工具

6.4.6.24 期末持有的其他金融工具
6.4.6.25 期末持有的其他金融工具

6.4.6.26 期末持有的其他金融工具
6.4.6.27 期末持有的其他金融工具

6.4.6.28 期末持有的其他金融工具
6.4.6.29 期末持有的其他金融工具

6.4.6.30 期末持有的其他金融工具
6.4.6.31 期末持有的其他金融工具

6.4.6.32 期末持有的其他金融工具
6.4.6.33 期末持有的其他金融工具

6.4.6.34 期末持有的其他金融工具
6.4.6.35 期末持有的其他金融工具

6.4.6.36 期末持有的其他金融工具
6.4.6.37 期末持有的其他金融工具

6.4.6.38 期末持有的其他金融工具
6.4.6.39 期末持有的其他金融工具

6.4.6.40 期末持有的其他金融工具
6.4.6.41 期末持有的其他金融工具

6.4.6.42 期末持有的其他金融工具
6.4.6.43 期末持有的其他金融工具

6.4.6.44 期末持有的其他金融工具
6.4.6.45 期末持有的其他金融工具

6.4.6.46 期末持有的其他金融工具
6.4.6.47 期末持有的其他金融工具

6.4.6.48 期末持有的其他金融工具
6.4.6.49 期末持有的其他金融工具

6.4.6.50 期末持有的其他金融工具
6.4.6.51 期末持有的其他金融工具

6.4.6.52 期末持有的其他金融工具
6.4.6.53 期末持有的其他金融工具

6.4.6.54 期末持有的其他金融工具
6.4.6.55 期末持有的其他金融工具

6.4.6.56 期末持有的其他金融工具
6.4.6.57 期末持有的其他金融工具

6.4.6.58 期末持有的其他金融工具
6.4.6.59 期末持有的其他金融工具

6.4.6.60 期末持有的其他金融工具
6.4.6.61 期末持有的其他金融工具

6.4.6.62 期末持有的其他金融工具
6.4.6.63 期末持有的其他金融工具

6.4.6.64 期末持有的其他金融工具
6.4.6.65 期末持有的其他金融工具

6.4.6.66 期末持有的其他金融工具
6.4.6.67 期末持有的其他金融工具

6.4.6.68 期末持有的其他金融工具
6.4.6.69 期末持有的其他金融工具

6.4.6.70 期末持有的其他金融工具
6.4.6.71 期末持有的其他金融工具

6.4.6.72 期末持有的其他金融工具
6.4.6.73 期末持有的其他金融工具

6.4.6.74 期末持有的其他金融工具
6.4.6.75 期末持有的其他金融工具

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 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额, etc.

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 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序的前五名债券投资明细
金额单位:人民币元

Table with 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
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序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
7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓合约及损益明细
注:无。

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范围。
7.10.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

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
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
金额单位:人民币元

Table with columns: 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额, etc.

8.2 期末本基金前十名持有人
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占基金份额比例(%)

基金管理人所有从业人员的持有基金份额情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 持有基金份额总数(份), 占基金份额比例(%)

9 开放式基金份额变动
单位:份

Table with columns: 基金合同生效日(2005年7月13日), 本报告期初基金份额总额, etc.

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。

10.3 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 为基金提供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 基金管理人、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、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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证券投资的情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 当期股票成交金额, etc.

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交易单元席位的选择标准和程序:
a) 证券选择标准
b) 券商提供的研究报告质量
c) 券商提供的研究支持
d) 券商提供的及时性及专业性
e) 券商提供的及时性及专业性
f) 券商提供的及时性及专业性

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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 当期股票成交金额, etc.

10.7.3 基金租用证券公司交易单元用于其他证券投资的情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 当期股票成交金额, etc.

10.7.4 基金租用证券公司交易单元用于其他证券投资的情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 当期股票成交金额, etc.

10.7.5 基金租用证券公司交易单元用于其他证券投资的情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 当期股票成交金额, etc.

10.7.6 基金租用证券公司交易单元用于其他证券投资的情况
金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 当期股票成交金额, etc.