南方隆元产业主题股票型证券投资基金

【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

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、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2013年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方隆元产业主题股票
基金主代码	202007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年11月9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	8,333,720,719.73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“南方隆元”。
2、本基金自2007年11月09日由封闭式基金隆元证券投资基金转型而成。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为积极型股票基金,在准确把握产业发展趋势和市场运行态势的基础上,集中精选具备国民经济三大产业主题的优势行业和上市公司进行投资,有效控制投资组合风险,追求较高的超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在投资策略上采取“自上而下”积极进行资产配置、行业轮动配置和“自下而上”精选个股相结合的方法。 在新一轮产业结构调整和产业升级中,发展先进制造业、提高现代服务业比重和加强基础产业基础设施建设,是国家产业结构调整的重要任务。因此,关于先进制造业、现代服务业和基础产业的投资主题即是本基金所指的三大“产业主题”。 在上述三大产业的基础上,本基金采取“自上而下”的方式进行行业配置,即基于行业竞争优势和市场结构等进行基本面分析,结合行业的历史表现、收益预期、行业经济政策面等,进行综合的相对吸引度评分,然后在市场基准比例的基础上进行行业的轮动配置,选择符合国家产业发展政策,在国民经济三大产业中占据行业优势地位,超额收益率或预测超额收益率水平较高的行业做重点投资。
业绩比较基准	85%×沪深300指数 + 15%×上证国债指数
风险收益特征	预期风险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	-724,008,113.44
本期利润	-1,050,215,305.25
加权平均基金份额本期利润	-0.1208
本期基金份额净值增长率	-22.24%
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	-0.0551
期末基金资产净值	3,643,805,386.93
期末基金份额净值	0.437
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)

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	-19.37%	2.05%	-13.31%	1.58%	-6.06%	0.47%
过去三个月	-16.92%	1.63%	-9.94%	1.23%	-6.98%	0.40%
过去六个月	-22.24%	1.49%	-10.59%	1.27%	-11.65%	0.22%
过去一年	-21.68%	1.33%	-8.38%	1.16%	-13.30%	0.17%
过去三年	-25.56%	1.37%	-10.12%	1.17%	-15.44%	0.20%
自基金转型至今	-56.30%	1.60%	-47.10%	1.65%	-9.20%	-0.05%

3.2.2 自基金转型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

基金份额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:本基金自2007年11月09日由封闭式基金隆元证券投资基金转型而成。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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
汪澈	本基金基金经理、公司投资部副总监	2008-4-11	-	13	注册金融分析师(CFA),工商管理硕士,具有基金从业资格。1999年加入南方基金,先后担任研究员、基金经理助理,2002年4月-2006年3月,任隆元基金经理;2005年8月-2006年3月,任金元基金经理;2006年3月至今,任开元基金经理;2008年4月至今,任南方隆元基金经理。
蒋朋宸	本基金基金经理	2008-4-11	-	9	北大生物化学硕士、美国哥伦比亚大学金融工程学硕士,具有基金从业资格。曾担任鹏华基金公司基金管理部分析师,2005年加入南方基金,2008年4月至今,任南方盛元基金经理;2008年4月至今,任南方隆元基金经理;2009年2月至今,任南方宝元债券基金经理。2010年12月至今,任基金天元基金经理。

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、南方隆元产业主题股票型证券投资基金合同》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年上半年,外围股市总体向好,由于美国经济露出一线复苏的曙光,资金从新兴市场回流美国使得新兴市场股市震荡幅度有所加大。中国A股市场总体表现在全球继续偏弱,蓝筹股指数表现较差,中小盘股票表现显著强于大盘。在美联储明确了QE退出的预期之后,全球大类资产中除美元以外的其他资产基本上都是下跌的。从各国看,新兴市场国家和日本资产从高位回落较大。中国新政府出重手治理银行业、地方融资平台以及房地产市场,在不进一步出台刺激政策的前提下加大促进经济结构转型的力度,6月份中国银行间市场资金成本出现创纪录的大幅度波动,引起了金融市场的短暂恐慌,股市在此背景下出现大幅下挫。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年上半年,本基金的净值增长率为-22.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从长期来看,我们认为08年的金融危机过后,中国经济进入了一个更均衡和更可持续的发展阶段。在目前企业资金链紧张的环境下,受国家政策和项目扶持的大型央企在资金、技术、资源等各方面都更具竞争力,同时大小非的减持压力也相对较小,我们将继续重点配置大型央企蓝筹股。

预计下半年中国经济将有所企稳,国务院的各项促进经济长期健康发展的措施将会陆续给经济带来正面影响,从而提升市场对经济和股市的信心。在此大背景下,A股市场将有望走出反弹行情,蓝筹股的趋跌反弹和相对补涨行情有望成为市场主要的热点。

本基金将坚持重点配置海洋经济和军工产业。美国重返亚太的全方位战略,实际上就是对中国的战略扼制。中国不断提高军事力量准备步伐和采取积极的国防防御政策是国家未来不可避免的大政方针之一,也是解决钓鱼岛问题和南海问题的必要措施。建设海洋强国是中国特色社会主义事业的重要组成部分。中国陆地人均资源贫乏,加大对广大周边海洋资源的开发,促进海洋经济的发展,将是国家新的重要经济增长点。现今我国必须要提高海洋资源开发能力,着力推动海洋经济向质量效益型转变,而发达的海洋经济是建设海洋强国的重要支撑。国家提出要提高海洋开发能力,扩大海洋开发领域,让海洋经济成为新的增长点。要加强海洋产业规划和指导,优化海洋产业结构,提高海洋经济增长质量,培育壮大海洋战略性新兴产业,提高海洋产业对经济增长的贡献率,努力使海洋产业成为国民经济的支柱产业,因此我们认为军工行业和大海洋行业若干上市公司将受益于上述战略发展。

本基金将坚持重点配置财富管理行业,尤其是非银行财富管理行业。从国外证券业发展的情况来看,当其经历了财富管理大发展后,行业的集中度已经充分提高,少数券商基本垄断市场,进入成熟稳定的时期。相比较国内的证券行业仍然相当分散,随着创新产品的不断推出,以及中国企业国内国外并购重组等业务的发展,证券行业未来的发展空间仍然很大,其中龙头券商的投资价值将进一步凸显。

本基金还将坚持配置美元资产和黄金资产。近几年国际金融危机的影响和本国劳动力成本的提高,中国的高速发展遇到了瓶颈,未来的挑战加剧。在连续数年人民币大幅升值以后,国内经济发展速度已经放缓,同时美联储给出退出QE的明确预期,造成了新兴市场国家货币贬值。在未来几年的时间内,预防人民币贬值而带来的资产损失将是投资的一个方向。本基金吸取亚洲各国及拉美各国货币贬值的经验教训,将继续重点关注美元资产和黄金资产。

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:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的60%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红,但未经确权的基金份额默认方式是红利再投资;基金投资当期出现净亏损,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;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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隆元产业主题股票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,南方隆元产业主题股票型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方隆元产业主题股票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,南方隆元产业主题股票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隆元产业主题股票型证券投资基金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:南方隆元产业主题股票型证券投资基金
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	257,316,099.32	258,859,609.61
结算备付金	1,334,871.47	2,403,459.17
存出保证金	745,013.71	365,660.98
交易性金融资产	3,420,469,303.63	4,859,296,425.58
其中:股票投资	3,300,217,303.63	4,742,938,425.58
基金投资	-	-
债券投资	120,252,000.00	116,358,000.00
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	-	25,117,364.16
应收利息	76,806.34	308,766.94
应收股利	-	-
应收申购款	268,521.52	557,312.78
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,680,210,615.99	5,146,908,599.22
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	17,347,625.23	-
应付赎回款	11,175,123.33	3,076,580.04
应付管理人报酬	5,147,283.55	6,153,553.17
应付托管费	857,880.60	1,025,592.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,135,203.10	1,565,135.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	742,113.25	926,610.59
负债合计	36,405,229.06	12,747,471.79
所有者权益:		
实收基金	2,163,817,709.57	2,371,545,418.78
未分配利润	1,479,987,677.36	2,762,615,708.65
所有者权益合计	3,643,805,386.93	5,134,161,127.43
负债和所有者权益总计	3,680,210,615.99	5,146,908,599.22

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.437元,基金份额总额8,333,720,719.73份。

6.2 利润表

会计主体:南方隆元产业主题股票型证券投资基金
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	-1,002,090,622.55	474,317,009.08
1.利息收入	1,199,143.97	1,279,072.61
其中:存款利息收入	957,253.71	1,240,767.82
债券利息收入	218,191.77	38,304.79
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	23,698.49	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-677,451,565.83	-416,544,748.22
其中:股票投资收益	-687,119,291.92	-441,030,751.60
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	9,667,726.09	24,486,003.38
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-326,207,191.81	889,240,595.78
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	368,991.12	342,088.91
减:二、费用	48,124,682.70	55,610,362.83
1.管理人报酬	34,990,499.01	40,290,671.19
2.托管费	5,831,749.90	6,715,111.86
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,091,264.77	8,379,889.88
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	211,169.02	224,689.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-1,050,215,305.25	418,706,646.25
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-1,050,215,305.25	418,706,646.25

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方隆元产业主题股票型证券投资基金
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)	2,371,545,418.78	2,762,615,708.65	5,134,161,127.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,050,215,305.25	-1,050,215,305.25
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)	-207,727,709.21	-232,412,726.04	-440,140,435.25
其中:1.基金申购款	70,583,441.89	80,739,219.82	151,322,661.71
2.基金赎回款	-278,311,151.10	-313,151,945.86	-591,463,096.96
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)	2,163,817,709.57	1,479,987,677.36	3,643,805,386.93
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)	2,486,159,252.48	2,443,755,026.68	4,929,914,279.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	418,706,646.25	418,706,646.25
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)	-75,431,414.84	-88,453,455.31	-163,884,870.15
其中:1.基金申购款	119,069,197.35	148,355,475.18	267,424,672.53
2.基金赎回款	-194,500,612.19	-236,808,930.49	-431,309,542.68
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)	2,410,727,837.64	2,774,008,217.62	5,184,736,055.26

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.对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”)	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	1,053,521,958.48	23.53%	-	-

债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	40,000,000.00	44.44%	-	-

6.4.5.1.2 权证交易

注: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	957,707.13	23.57%	-	-
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	-	-	-	-

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	34,990,499.01	40,290,671.19
其中:支付销售机构的客户维护费	5,570,851.23	6,391,834.25

注:支付基金管理人南方基金公司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	5,831,749.90	6,715,111.86

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

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
基金合同生效日(2007年11月9日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	51,273,804.55
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	-	51,273,804.55
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

注:期间申购总份额含红利再投、转换入份额,期间赎回总份额含转换出份额。

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	257,316,099.32	918,177.39	278,280,925.39	1,206,698.06

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

注:无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

注: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

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。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

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
601989	中国重工	2013-5-17	重大事项停牌	3.78	-	-	77,908,955	385,615,209.45	294,495,849.90	-
600547	山东黄金	2013-4-3	重大事项停牌	24.30	2013-7-1	28.77	7,075,000	320,892,138.37	171,922,500.00	-

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。

§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	3,300,217,303.63	89.67
	其中:股票	3,300,217,303.63	89.67
2	固定收益投资	120,252,000.00	3.27
	其中:债券	120,252,000.00	3.27
	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	258,650,970.79	7.03
6	其他各项资产	1,090,341.57	0.03
7	合计	3,680,210,615.99	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	735,330,746.60	20.18
C	制造业	1,334,736,665.47	36.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	128,070,572.70	3.51
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	304,435,956.00	8.35
G	交通运输、仓储和邮政业	91,974,033.56	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,868,000.00	0.66
J	金融业	681,801,329.30	18.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,300,217,303.63	90.57

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	601989	中国重工	77,908,955	294,495,849.90	8.08
2	600837	海通证券	29,851,458	280,006,676.04	7.68
3	600030	中信证券	27,558,576	279,168,374.88	7.66
4	600739	辽宁成大	21,000,000	275,520,000.00	7.56
5	601808	中海油服	12,753,455	179,696,180.95	4.93
6	600583	海油工程	27,216,654	176,091,751.38	4.83
7	600547	山东黄金	7,075,000	171,922,500.00	4.72
8	600150	中国船舶	10,219,162	165,243,849.54	4.53
9	600489	中金黄金	15,979,049	148,445,365.21	4.07
10	600863	内蒙华电	22,667,358	128,070,572.70	3.51

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	600030	中信证券	336,481,659.11	6.55
2	600837	海通证券	294,759,373.33	5.74
3	600316	洪都航空	143,384,534.50	2.79
4	000768	中航飞机	138,842,654.56	2.70
5	600523	贵航股份	131,981,607.32	2.57
6	600739	辽宁成大	131,253,454.37	2.56
7	601318	中国平安	122,447,513.88	2.38
8	601718	际华集团	113,485,854.99	2.21
9	601901	方正证券	106,604,218.72	2.08
10	601857	中国石油	58,243,262.24	1.13
11	000878	云南铜业	50,120,247.77	0.98
12	601989	中国重工	43,832,137.13	0.85
13	600456	宝钛股份	40,040,184.69	0.78
14	000063	中兴通讯	36,924,249.63	0.72
15	600118