南方盛元红利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：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2013年8月27日

§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。

基金托管人中国建设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	2,244,759,393.32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，以及高债息固定收益类投资品种。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	66,395,545.85
本期利润	-44,096,425.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0175
本期基金份额净值增长率	-2.56%
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	-0.2390
期末基金资产净值	1,708,321,479.07
期末基金份额净值	0.761

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	-9.08%	1.67%	-14.29%	1.75%	5.21%	-0.08%
过去三个月	0.53%	1.31%	-11.90%	1.35%	12.43%	-0.04%
过去六个月	-2.56%	1.26%	-11.56%	1.53%	9.00%	-0.27%
过去一年	-0.91%	1.23%	-6.16%	1.29%	5.25%	-0.06%
过去三年	-4.88%	1.38%	-13.11%	1.17%	8.23%	0.21%
自基金合同生效起至今	-16.20%	1.47%	-47.00%	1.72%	30.80%	-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。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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

今年是十八大胜利召开后新一届政府展开履工作的第一个整年，上半年的资本市场对新政府可能带来的经济增长方式转型抱有非常高的期待，另一方面今年也是创业板大非解禁的第一年，市场认为伴随着大非解禁相关公司业绩会有不俗表现，基于这两方面原因，以创业板为代表的新经济成长股上半年的表现风光无限。另一方面，以主板为代表的传统经济价值股表现不尽人意，上半年创业板指数上涨41.7%，同期沪深300指数下跌12.8%，市场风格严重分化，分化程度也是历史罕见的。

本基金在报告期内，重点配置了估值较低、长期成长性良好的寡头装备制造、品牌消费、地产等板块，尽管较业绩基准取得了一定超额收益，但由于对创业板配置不足，整体收益并不理想。回顾上半年的操作，我们认为既要坚持长期价值投资的理念，也要对市场的热点和趋势背后的逻辑更加深刻的研究，以更加开放的心态理解认识市场。市场短期是选美比赛，长期仍是个称重机，目前部分成长股过高的估值需要有真实业绩的验证才能支撑，而不能仅仅靠故事或幻想，另一方面部分价值股的估值处于历史底部区域，而其基本面并不像股价那样糟糕，长期投资价值日益明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.761元，报告期内，份额净值增长率为 -2.56%，同期业绩基准增长率为-11.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，我们需要关注几个重要事件的进展和影响：一是十八届三中全会的召开，对于我国经济增长发展方式的解读会更加全面，以及四季度可能看到的各项经济托底政策的具体落实，会在一定时期内引导着我们投资的主线；二是美国QE退出，我们认为QE退出和削减的方向是确定的，由此引致的包括我国在内的新兴市场资金外流和风险偏好的变化值得警惕；三是IPO重启，以及由此可能导致的市场风格转换。

展望未来，我们认为宏观政策阶段性底部已现，当前政策侧重点已经有所调整，稳增长是当前重要目标。目前强调盘活存量的基础上，预计三季度各项政策会向着较为平衡或略宽松方向发展，注重提升稳增长在政策执行中的权重。因此，下半年我们会采取更加积极的操作策略。具体来讲，我们会紧密围绕稳增长的几条主线进行投资，在政府财政收入紧张的背景下，大的国有企业投资会成为稳增长的重要支撑，包括电力设备投资、轨道交通投资、4G投资等，另一方面，地产政策着眼长远的积极变化有利于地产股的估值修复。对于成长股的投资，我们会进一步加强研究，提高筛选标准，选择有真实业绩支撑的真成长股，规避讲故事但难以兑现业绩的估值虚高个股。努力为广大持有人创造良好投资回报。

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，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。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方盛元红利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	38,075,235.09	119,598,786.78
结算备付金	4,528,093.06	413,644.27
存出保证金	687,658.66	1,593,472.41
交易性金融资产	1,547,209,617.97	2,234,446,564.43
其中：股票投资	1,437,459,617.97	2,194,466,564.43
基金投资	-	-
债券投资	109,750,000.00	39,980,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	121,100,621.65	-
应收证券清算款	1,435,592.20	20,493,940.97
应收利息	1,076,338.65	733,389.66
应收股利	285,000.00	-
应收申购款	122,251.89	116,357.46
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,714,520,409.17	2,377,396,155.98
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	-	25,443,982.31
应付赎回款	1,908,650.68	1,538,396.30
应付管理人报酬	2,210,992.82	2,740,553.23
应付托管费	368,498.79	456,758.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,265,661.88	517,131.45
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	445,125.93	1,897,440.12
负债合计	6,198,930.10	32,594,262.30
所有者权益：		
实收基金	2,244,759,393.32	3,001,747,421.54
未分配利润	-536,437,914.25	-656,945,527.86
所有者权益合计	1,708,321,479.07	2,344,801,893.68
负债和所有者权益总计	1,714,520,409.17	2,377,396,155.98

注：报告截止日2013年06月30日，基金份额净值0.761元，基金份额总额2,244,759,393.32份；

6.2 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：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	-20,975,131.42	216,631,766.99
1.利息收入	4,741,265.36	1,939,772.55
其中：存款利息收入	354,209.44	210,951.03
债券利息收入	2,091,592.05	1,728,821.52
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,295,463.87	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	84,492,713.47	-208,715,330.48
其中：股票投资收益	66,230,761.00	-219,613,891.59
基金投资收益	-	-
债券投资收益	85,057.62	41,569.45
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	18,176,894.85	10,856,991.66
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-110,491,970.89	423,341,306.44
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	282,860.64	66,018.48
减：二、费用	23,121,293.62	27,132,316.25
1.管理人报酬	14,808,412.36	18,677,918.40
2.托管费	2,468,068.76	3,112,986.42
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	5,626,399.95	5,125,231.69
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	218,412.55	216,179.74
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-44,096,425.04	189,499,450.74
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-44,096,425.04	189,499,450.74

6.3 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：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)	3,001,747,421.54	-656,945,527.86	2,344,801,893.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-44,096,425.04	-44,096,425.04
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）	-756,988,028.22	164,604,038.65	-592,383,989.57
其中：1.基金申购款	26,294,339.12	-5,641,499.97	20,652,839.15
2.基金赎回款	-783,282,367.34	170,245,538.62	-613,036,828.72
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)	2,244,759,393.32	-536,437,914.25	1,708,321,479.07
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)	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(本期利润)	-	189,499,450.74	189,499,450.74
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）	196,640,173.10	-39,408,347.90	157,231,825.20
其中：1.基金申购款	331,571,554.60	-68,952,747.87	262,618,806.73
2.基金赎回款	-134,931,381.50	29,544,399.97	-105,386,981.53
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)	3,389,226,199.25	-784,666,788.79	2,604,559,410.46

报表附注为本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 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、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”）	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
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

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
兴业证券	304,974,237.94	8.81%	699,761,021.31	20.60%

6.4.5.1.2 债券交易

无。

6.4.5.1.3 债券回购交易

无。

6.4.5.1.4 权证交易

无。

6.4.5.1.5 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
兴业证券	269,872.39	8.67%	106,270.42	8.41%
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
兴业证券	570,564.45	20.13%	325,053.27	26.75%

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	14,808,412.36	18,677,918.40
其中：支付销售机构的客户维护费	3,420,626.71	2,763,723.69

注：1、本基金已于2009年3月23日转为开放式。

2、转为开放期后，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	2,468,068.76	3,112,986.42

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。

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

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

份额单位：份

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（2008年3月21日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	58,806,500.35	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	-	-
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	2.62%	3.07%

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

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
中国建设银行	38,075,235.09	317,202.57	12,036,364.92	186,514.72

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。

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

6.4.6.1.1 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27日	非公开发行流通受限	20.22	23.95	1,484,900	30,024,678.00	35,563,355.00	-
600509	天富热电	2013年3月21日	2014年3月19日	非公开发行流通受限	7.55	7.81	4,000,000	30,200,000.00	31,240,000.00	-
600216	浙江医药	2012年8月24日	2013年8月26日	非公开发行流通受限	18.33	20.16	1,500,000	27,495,000.00	30,240,000.00	-
600578	京能热电	2013年4月2日	2014年3月31日	非公开发行流通受限	6.92	6.92	4,000,000	27,680,000.00	27,680,000.00	-

注：基金可作为特定投资者，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
000999	华润三九	2013年6月3日	重大资产重组	29.60	2013年8月19日	26.51	400,000.00	12,303,905.08	11,840,000.00	-

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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	1,437,459,617.97	83.84
	其中：股票	1,437,459,617.97	83.84
2	固定收益投资	109,750,000.00	6.40
	其中：债券	109,750,000.00	6.40
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	121,100,621.65	7.06
	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	42,603,328.15	2.48
6	其他各项资产	3,606,841.40	0.21
7	合计	1,714,520,409.17	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	4,870,782.00	0.29
C	制造业	528,698,509.95	30.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,476,000.00	3.66
E	建筑业	130,265,652.28	7.63
F	批发和零售业	24,708,953.00	1.45
G	交通运输、仓储和邮政业	36,163,159.56	2.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	135,863,000.00	7.95
J	金融业	225,922,032.24	13.22
K	房地产业	150,784,068.96	8.83
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,382,000.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	45,314,887.66	2.65
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	9,251,000.00	0.54
S	综合	77,759,572.32	4.55
	合计	1,437,459,617.97	84.14

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	600406	国电南瑞	9,100,000	135,863,000.00	7.95
2	600519	贵州茅台	571,367	109,913,869.79	6.43
3	000651	格力电器	3,417,323	85,638,114.38	5.01
4	600256	广汇能源	5,999,967	77,759,572.32	4.55
5	600036	招商银行	5,999,852	69,598,283.20	4.07
6	600240	华业地产	14,000,000	59,780,000.00	3.50
7	601166	兴业银行	4,000,020	59,080,295.40	3.46
8	601877	正泰电器	2,299,930	45,630,611.20	2.67
9	600703	三安光电	2,237,816	43,950,706.24	2.57
10	002375	亚厦股份	1,407,445	43,349,306.00	2.54

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	600036	招商银行	80,209,463.75	3.42
2	600000	浦发银行	56,864,980.29	2.43
3	601877	正泰电器	48,472,404.14	2.07
4	600016	民生银行	47,921,664.04	2.04
5	000001	平安银行	45,908,113.88	1.96
6	601788	光大证券	45,574,692.06	1.94
7	600999	招商证券	45,503,075.47	1.94
8	601006	大秦铁路	45,374,889.25	1.94
9	601699	潞安环能	44,605,068.43	1.90
10	600703	三安光电	42,006,474.68	1.79
11	000100	TCL集团	39,522,615.77	1.69
12	600837	海通证券	36,749,105.31	1.57
13	600572	康恩贝	36,504,925.08	1.56
14	600309	万华化学	35,240,846.28	1.50
15	000024	招商地产	31,641,885.63	1.35
16	300027	华谊兄弟	30,406