

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计 买入金额	占期初基金资 产净值比例 (%)
----	----------	------	--------------	------------------------

2	CTIC Pacific Limited	267 HK	640,606.10	0.62
3	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	2039 HK	408,155.49	0.39
4	Shenguan Holdings Group LTD	829 HK	214,330.66	0.21
5	WISON ENGINEERING SERVICES C	2236 HK	178,874.00	0.17
6	Shui On Land Limited	272 HK	154,411.68	0.15
7	CIFI Holdings Group Co Ltd	884 HK	142,515.97	0.14
8	Brilliance China Automotive Holdings Limited	1114 HK	141,076.01	0.14
9	Sinokang (Hong Kong) Limited	3808 HK	137,111.05	0.13
10	SPG Land (Holdings) Limited	337 HK	125,490.00	0.12
11	Huaseen Kelon Electrical Holdings Company Limited	921 HK	123,655.73	0.12
12	Texhong Textile Group Ltd.	2678 HK	115,207.20	0.11
13	Gemdale Properties and invest	535 HK	109,785.90	0.11
14	WINTeam PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	570 HK	104,612.66	0.10
15	LI NING COMPANY LIMITED	2331 HK	102,516.63	0.10
16	TCL Communication Technology Holdings Limited	2618 HK	98,458.98	0.10
17	Weiqiao Textile Company Limited	2698 HK	93,639.06	0.09
18	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	92,315.22	0.09
19	Future Land Development Holdings	1030 HK	92,233.36	0.09
20	Towngas China Company Limited	1083 HK	88,637.20	0.09

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元				
序			本期累计卖出	占期初基金资产净

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期承诺金额	占比比例(%)
1	China Gas Holdings Limited	384 HK	837,879.24	0.81

1	ENN Energy Holdings Limited	2688 HK	709,647.78	0.69
2	Brilliance China Automotive Holdings Limited	1114 HK	529,320.50	0.51
3	Biostrate International Holdings Limited	1112 HK	527,810.39	0.51
5	Shimao Property Holdings Limited	815 HK	520,570.78	0.50
6	China Shipping Development Company Limited	1138 HK	452,202.57	0.44
7	CSOFCO Pacific Limited	1199 HK	420,890.21	0.41
8	China State Construction International Holdings Limited	3311 HK	416,539.63	0.40
9	Guangzhou R And F Properties Co.Ltd.	2777 HK	406,176.25	0.39

10	China Resources Logistic Limited	1193 HK	398,676.21	0.38
11	Beijing Enterprises Water Group Limited	371 HK	383,754.30	0.37
12	Hopson Development Holdings Ltd.	754 HK	379,333.76	0.37
13	GCL-Poly Energy Holdings Ltd.	3800 HK	378,428.64	0.37
14	Shenzhen International Holdings Limited	152 HK	370,537.14	0.36
15	SHANGHAI CHINA LIFE HOLDINGS LIMITED	3683 HK	367,914.27	0.36
16	Guangdong Investment Limited	270 HK	361,605.60	0.35
17	Angang Steel Company Limited	347 HK	359,120.35	0.35
18	Lee And Man Paper Manufacturing Limited	2314 HK	357,361.65	0.35
19	Sino Biopharmaceutical Limited	1177 HK	356,139.10	0.34
20	Shanghai Industrial Holdings Limited	363 HK	341,687.67	0.33

7. 5. 3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

买入成本(成交)总额	5,276,316.77
卖出收入(成交)总额	37,358,064.32

注:买入成本和卖出收入均按买入或卖出金额,按公允价值乘以成交数量填列,不考虑相关交易费用

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

7.7 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  
本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细  
本基金本报告期末未持有基金。

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	474,946.39
4	应收利息	584.48
5	应收申购款	61,118.57
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	536,649.44

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
3,211	21,311.98	21,722,414.60	31.74%	46,710,348.70	68.26%

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	华泰证券股份有限公司	1,413,883.00	64.36%
2	赵敏	84,011.00	3.82%

3	许幼明	80,000.00	3.64%
4	穆丽蓉	62,719.00	2.85%
5	骆秀奎	52,277.00	2.38%
6	高玲	50,300.00	2.29%

7	郑丰任	34,200.00	1.56%
8	莫展桥	29,200.00	1.33%
9	张桂银	27,925.00	1.27%
10	周华仙	27,000.00	1.23%

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,820,292.58	5.5825%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研部门负责人持有本基金份额的数量区间为50至100万份，其余持有本基金份额的自然人数量区间为10万份至50万份。

§9 开放式基金份额变动		单位:份
基金合同生效日(2011年9月26日)基金份额总额		299,844,354.08
本报告期期初基金份额总额		97,268,678.89

本报告期基金总申购份额	22,483,862.83
减：本报告期基金总赎回份额	51,319,778.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	68,432,763.30

10.1 基金份额持有人大会决议	§10 重大事件揭示
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]113号文函复,基金管理人于2013年11月5日发布公告,自2013年11月1日起,高良玉不再担任公司总经理职务,由董事长吴万涛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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人管理的南方元沪深300交易型开放式指数证券投资基金(元元300ETF)在集中申购期间沪深300指数自然权重比例受停牌的水泰能源股票影响,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),行政监管措施决定书,认为基金管理人在元元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

制制度建设薄弱,缺乏ETF募集期股票赎回的相应制度安排;按照《证券投资基金信息披露管理办法》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

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	股票交易		应付该券商的佣金		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	
China Securities Securities Ltd.	42,248,454.14	100.00%	\$0,818.10	07.27%	

First Shanghai Securities Ltd.	42,348,424.14	100.00%	50,818.19	97.37%	--
Nomura (Hong Kong) Limited	--	--	--	--	--
CITIC Securities International Company Limited	--	--	--	--	--
UBS Securities Asia Limited	--	1,370.78	2.63%	--	--
China Construction Bank International Securities Limited	--	--	--	--	--

泰君安	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-
Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-

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	债券回购交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
East Shanghai Securities Ltd.				

First Shanghai Securities Ltd.	—	—	—
Nomura (Hong Kong) Limited	—	—	—
CITIC Securities International Company Limited	—	—	—
UBS Securities Asia Limited	—	1,718,453.02	100.00%
China Construction Bank International Securities Limited	—	—	—

泰君安	-	-	-
华泰证券	-	-	-
Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-

注：券商选择标准和程序：  
为保障公司境外证券投资的顺利开展，规范券商选择及交易分层标准与原则，基金管理人明确了

4) 交易执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量执行能力的指标主要有：是否成交及时、成交的有效性、成交的数量、证券取得较高的质量。

4. 提供专业服务的质量。主要指券商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和其他专业服务的质量。

B. 券商交易量分仓。公司将定期根据交易执行能力、研究机构的实力和水平、提供专业服务的质量等标准对交易券商进行打分考核,并根据考核结果拟定下期的交易量分配。