南方宝元债券型基金

【2014】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:2014年8月26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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方宝元债券
基金主代码	202101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月20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	882,472,006.99份
基金合同存续期	不定期

注: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“南方宝元”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为开放式债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅,在保持投资组合低风险和充分流动性的前提下,确保基金安全及追求资产长期稳定增值。
投资策略	南方宝元债券型基金采取自上而下的投资策略,通过对宏观经济形势以及财政货币政策的深入分析,确定资产配置的指导原则,在此基础上依照收益率与风险特征对不同金融产品的投资比例进行合理配置,并随投资环境的变化及时做出调整。力争在控制利率风险与市场风险的同时,为投资者获取稳定收益。
业绩比较基准	南方宝元债券型基金采用“75%交易所国债指数+25%(上证A股指数+深证A股指数)”为业绩比较基准。
风险收益特征	南方宝元债券型基金属于证券投资基金中的低风险品种,其风险收益配比关系为低风险、适度收益。

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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	73,419,251.39
本期利润	67,317,169.45
加权平均基金份额本期利润	0.0741
本期基金份额净值增长率	5.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2362
期末基金资产净值	1,177,058,125.37
期末基金份额净值	1.3338

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)。

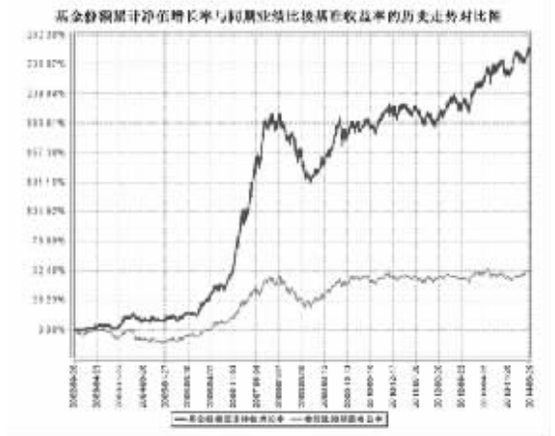
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.27%	0.34%	0.67%	0.24%	1.60%	0.10%
过去三个月	3.88%	0.32%	3.98%	0.25%	-0.10%	0.07%
过去六个月	5.96%	0.40%	5.17%	0.28%	0.79%	0.12%
过去一年	8.27%	0.44%	3.49%	0.31%	4.78%	0.13%
过去三年	18.86%	0.43%	4.14%	0.32%	14.72%	0.11%
自基金合同生效起至今	251.01%	0.53%	53.31%	0.42%	197.70%	0.11%

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



§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

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳,注册资本1.5亿元人民币。股东结构为: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%);兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近2,800亿元,旗下管理51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
蒋朋宸	本基金的基金经理	2009年2月10日	-	10	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2010年12月,任南方盛元基金经理;2008年4月至2014年1月,任南方隆元基金经理;2010年12月至2014年7月,任基金天元基金经理;2009年2月至今,任南方宝元债券基金经理。
应帅	本基金的基金经理	2010年12月2日	-	13	北大光华管理学院管理学硕士,具有基金从业资格。曾担任长城基金管理公司行业研究员,2007年加入南方基金,2007年5月至2009年2月,任南方宝元基金经理;2007年5月至2012年11月,任南方成份基金经理;2010年12月至今,任南方宝元基金经理;2012年11月至今,任南方稳健基金经理;2012年11月至今,任南稳弢号基金经理。

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、《南方宝元债券型基金基金合同》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4次,其中1次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致,3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

2014年上半年,市场依然出现明显的分化,但震荡开始加剧,行情时有反复。上半年大股票表现疲软,而中证500为代表的中小市值个股则出现较为明显的上涨,创业板经历了去年大幅度上涨之后,尽管在今年上半年依然上涨,但已经显露出颓势,并且在3至5月出现了较为明显的回调。风格特征上,强势的计算机、通信仍维持强势,体现了市场对于未来互联网发展方向的持续认同,而以金融、地产为代表的低估值行业出现恢复性的上涨,在政府不断出台稳增长政策的背景下出现了底部企稳的特征。本基金在上半年大幅降低了普通大众消费品的配置,兑现了部分智慧城市的个股收益,增加了计算机、互联网板块的配置,以及一些基本面好转的低估值个股配置。仓位方面,本基金基本维持稳定,并未做大幅度调仓行为。

14年上半年债券市场迎来了较好的投资机会。本基金持有的金融债和城投债都获得了较好的收益。上半年本基金在债券方面维持持有策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年上半年沪深300指数增长率为-7.08%,本基金净值增长率为5.96%,业绩基准为5.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管经济还处于转型和调整期,但政府不断通过一些“微刺激”政策,来维持经济的稳定增长。政策面的宽松以及经济预期有所稳定,使得资本市场开始有所好转,对于下半年证券市场本基金开始积极转向乐观,预计低估值蓝筹会有较好的投资机会。

债券市场经历了较长时间的上涨之后,我们倾向于谨慎乐观,未来将重点研究可转债的投资机会。

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,组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。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:基金收益分配比例按有关规定制定;投资者可以选择现金分红方式或分红再投资的分红方式,以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准,投资者选择分红的默认方式为现金分红;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,才可进行当期收益分配;在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次,但若成立不满3个月则不进行收益分配,年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成;基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值;每一基金单位享有同等分配权。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金未有收益分配事项。本报告期内2014年1月14日已分配数(每10份基金份额派发红利0.20元)为以往年度收益分配。

§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

2014年上半年,本基金托管人在对南方宝元债券型基金的托管过程中,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

2014年上半年,南方宝元债券型基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方宝元债券型基金的投资运作、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,南方宝元债券型基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为18,257,653.04元。

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宝元债券型基金2014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:南方宝元债券型基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		26,311,054.27	21,313,955.65
结算备付金		3,496,161.20	5,369,628.25
存出保证金		243,645.99	173,378.22
交易性金融资产		1,308,822,069.54	1,398,278,551.87
其中:股票投资		358,099,058.90	366,787,402.59
基金投资		-	-
债券投资		950,723,010.64	1,031,491,149.28
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		25,328,884.58	20,215,371.61
应收股利		-	-
应收申购款		285,792.56	1,402,497.30
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,364,487,608.14	1,446,753,382.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		170,000,000.00	266,000,000.00
应付证券清算款		13,929,635.38	270,875.21
应付赎回款		2,087,563.19	3,011,003.96
应付管理人报酬		718,936.15	748,301.89
应付托管费		167,751.75	174,603.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		322,371.00	412,498.22
应交税费		-	-
应付利息		-	413,236.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		203,225.30	189,572.73
负债合计		187,429,482.77	271,220,091.87
所有者权益:			
实收基金		882,472,006.99	919,243,201.09
未分配利润		294,586,118.38	256,290,089.94
所有者权益合计		1,177,058,125.37	1,175,533,291.03
负债和所有者权益总计		1,364,487,608.14	1,446,753,382.90

注:1、报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.3338元,基金份额总额882,472,006.99份。2、后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:南方宝元债券型基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		79,258,607.96	69,788,528.51
1.利息收入		25,436,535.46	24,924,648.23
其中:存款利息收入		161,640.16	128,614.04
债券利息收入		25,274,895.30	24,796,034.19
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)		59,787,913.41	38,009,544.33
其中:股票投资收益		47,157,858.61	32,308,500.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益		8,443,412.32	431,073.46
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		4,186,642.48	5,269,970.49
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-6,102,081.94	6,749,159.81
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		136,241.03	105,176.14
减:二、费用		11,941,438.51	11,568,339.95
1.管理人报酬		4,389,726.41	4,586,590.57
2.托管费		1,024,269.48	1,070,204.46
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,544,737.80	1,412,862.40
5.利息支出		4,764,342.84	4,294,279.10
其中:卖出回购金融资产支出		4,764,342.84	4,294,279.10
6.其他费用		218,361.98	204,403.42
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		67,317,169.45	58,220,188.56
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		67,317,169.45	58,220,188.56

注:1、后附6.4报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方宝元债券型基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	919,243,201.09	256,290,089.94	1,175,533,291.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	67,317,169.45	67,317,169.45
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)	-36,771,194.10	-10,763,487.97	-47,534,682.07
其中:1.基金申购款	103,217,030.11	30,870,064.82	134,087,094.93
2.基金赎回款	-139,988,224.21	-41,633,552.79	-181,621,777.00
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)	-	-18,257,653.04	-18,257,653.04
五、期末所有者权益(基金净值)	882,472,006.99	294,586,118.38	1,177,058,125.37
项目	上年度可比期间 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)	1,010,821,578.24	215,781,786.17	1,226,603,364.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	58,220,188.56	58,220,188.56
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)	-36,044,680.71	-8,724,338.28	-44,769,018.99
其中:1.基金申购款	77,099,438.53	18,328,192.27	95,427,630.80
2.基金赎回款	-113,144,119.24	-27,052,530.55	-140,196,649.79
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)	-	-20,086,888.06	-20,086,888.06
五、期末所有者权益(基金净值)	974,776,897.53	245,190,748.39	1,219,967,645.92

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:

_____ _____ _____

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声明

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[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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2014年1月1日至2014年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	160,277,367.81	15.84%	33,915,162.53	3.70%

债券交易

注:无。

债券回购交易

注:无。

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 2014年1月1日至2014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	141,830.38	15.67%	71,269.38	22.14%
关联方名称	上年度可比期间 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	30,011.91	3.66%	-	-

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,389,726.41	4,586,590.57
其中:支付销售机构的客户维护费	113,700.56	104,207.12

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0.75%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 0.75% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,024,269.48	1,070,204.46

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0.175%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 0.175% / 当年天数。

6.4.5.2.3 销售服务费

注:无

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

注:无。

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 2014年1月1日至2014年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国工商银行	26,311,054.27	117,639.05	3,176,368.01	83,647.81

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(2014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

无。

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
600071	凤凰光学	2014年6月30日	股价异常临时停牌	12.39	2014年7月1日	12.81	999,894	10,113,612.08	12,388,686.66	-
300295	三六五网	2014年4月11日	重大事项停牌	96.81	2014年7月8日	105.00	60,000	4,928,382.86	5,808,600.00	-

注:本基金截至2014年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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

截至本报告期末2014年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额170,000,000.00元,于2014年7月7日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§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	358,099,058.90	26.24
	其中:股票	358,099,058.90	26.24
2	固定收益投资	950,723,010.64	69.68
	其中:债券	950,723,010.64	69.68
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	29,807,215.47	2.18
7	其他各项资产	25,858,323.13	1.90
8	合计	1,364,487,608.14	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,694,805.20	0.31
C	制造业	180,650,720.25	15.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,220,957.25	1.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,890,702.56	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	10,096,000.00	0.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,100,957.16	6.38
J	金融业	27,134,466.00	2.31
K	房地产业	6,368,398.56	0.54
L	租赁和商务服务业	2,903,477.72	0.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,377,348.20	0.97
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	8,661,226.00	0.74
S	综合	-	-
	合计	358,099,058.90	30.42

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	600071	凤凰光学	999,894	12,388,686.66	1.05
2	601006	大秦铁路	1,600,000	10,096,000.00	0.86
3	300075	数字政通	307,500	9,941,475.00	0.84
4	300020	银江股份	308,960	9,454,176.00	0.80
5	600519	贵州茅台	65,891	9,355,204.18	0.79
6	600697	欧亚集团	519,434	9,266,702.56	0.79
7	002595	豪迈科技	193,105	9,104,900.75	0.77
8	002048	宁波华翔	599,995	8,939,925.50	0.76
9	600566	洪城股份	380,600	8,791,860.00	0.75
10	600373	中文传媒	618,659	8,661,226.00	0.74

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	300170	汉得信息	18,514,727.13	1.58
2	002396	星网锐捷	11,472,478.86	0.98
3	601006	大秦铁路	11,085,639.81	0.94
4	000001	平安银行	10,881,898.80	0.93
5	600703	三安光电	10,775,199.63	0.92
6	300212	易华录	10,742,995.93	0.91
7	600519	贵州茅台	10,401,665.72	0.88
8	600071	凤凰光学	10,113,612.08	0.86
9	002146	荣盛发展	10,098,333.47	0.86
10	300155	安居宝	9,941,779.10	0.85
11	600566	洪城股份	9,558,915.81	0.81
12	600697	欧亚集团	9,286,802.57	0.79
13	000700	模塑科技	9,207,341.40	0.78
14	300010	立思辰	9,163,491.52	0.78
15	600323	瀚蓝环境	8,479,468.03	0.72
16	600373	中文传媒	8,399,888.19	0.71
17	601099	太平洋	8,332,279.39	0.71
18	000939	凯迪电力	8,282,857.57	0.70
19	601877	正泰电器	8,197,570.79	0.70
20	300005	探路者	7,894,994.57	0.67

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	19,426,043.54	1.65
2	002415	海康威视	14,261,824.84	1.21
3	300070	碧水源	13,895,111.91	1.18
4	002565	上海绿新	13,561,493.17	1.15
5	002410	广联达	12,461,061.75	1.06
6	300170	汉得信息	11,777,629.14	1.00
7	600406	国电南瑞	11,217,772.63	0.95
8	600583	海油工程	10,427,675.38	0.89
9	000895	双汇发展	10,413,244.82	0.89
10	600446	金证股份	10,373,714.56	0.88
11	600703	三安光电	10,283,645.68	0.87
12	002191	劲嘉股份	10,037,199.59	0.85
13	002236	大华股份	9,859,044.39	0.84
14	002146	荣盛发展	9,838,863.62	0.84
15	601099	太平洋	9,750,620.29	0.83