

南方策略优化股票型证券投资基金 2011 年 半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 18 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。

本报告期自基金合同生效日 2011 年 1 月 1 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对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.....	12
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 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.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	37
7.9 投资组合报告附注.....	37
§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	38
§9 开放式基金份额变动	38

§10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
§11 备查文件目录	42
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方策略优化股票型证券投资基金
基金简称	南方策略优化股票
基金主代码	202019
前端交易代码	202019
后端交易代码	202020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 3 月 30 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,094,876,086.03 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“南方策略”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略，在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置策略，基金管理人开发了基于 lack-Litterman 模型的“南方量化行业配置模型”。在行业配置的基础上，进一步使用“南方多因子量化选股模型”，依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分，精选各行业具有超额收益能力或潜力的优势个股，构建本基金的股票组合。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	400-889-8899	95555
传真	0755-82763889	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	吴万善	傅育宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

§ 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(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	13,906,559.86
本期利润	-44,778,332.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0378
本期加权平均净值利润率	-3.93%
本期基金份额净值增长率	-5.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-105,392,293.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0963
期末基金资产净值	989,483,792.19
期末基金份额净值	0.904
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-7.80%

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、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。

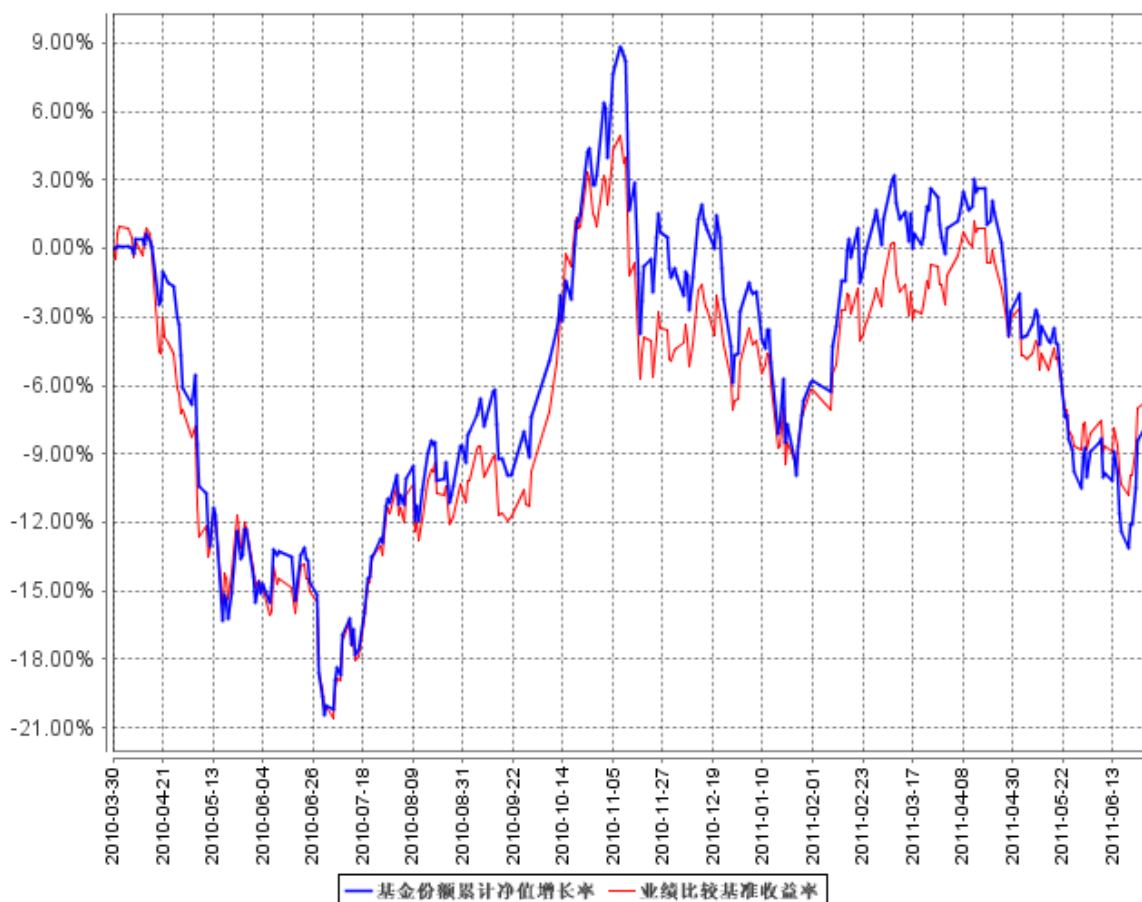
3.2 基金净值表现

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	1.46%	1.20%	1.19%	0.95%	0.27%	0.25%
过去三个月	-7.62%	1.09%	-4.28%	0.88%	-3.34%	0.21%
过去六个月	-5.15%	1.15%	-1.67%	0.99%	-3.48%	0.16%
过去一年	14.67%	1.28%	15.72%	1.12%	-1.05%	0.16%
自基金合同生效起至今	-7.80%	1.32%	-6.60%	1.20%	-1.20%	0.12%

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

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



§ 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金字[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金字[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%。

截至报告期末，公司管理资产规模近 1,900 亿元，管理 2 只封闭式基金——基金开元、基金天元；27 只开放式基金——南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金、南方高增长基金、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长

贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方全球精选配置基金（QDII 基金）、南方盛元红利股票型基金、南方优选价值股票型基金、南方恒元保本混合型基金、南方沪深 300 指数基金、南方中证 500 指数基金、深证成份交易型开放式指数基金、南方深证成份交易型开放式指数基金联接基金、南方策略优化股票型基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金联接基金、南方广利回报债券型基金和南方金砖四国指数基金（QDII 基金）、南方优选成长混合型基金、南方中证 50 债券指数基金和南方保本混合型基金；以及多个全国社保、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		
刘治平	数量化投资部总监、本基金的基金经理	2010 年 3 月 30 日	-	14	美国康奈尔大学工商管理硕士、美国佛罗里达州立大学计算物理学博士，曾获得美国证券及股票交易从业资格，具有中国基金从业资格。曾先后担任香港巴克莱投资银行可转债交易总监、美国纽约贝尔斯登可转债对冲基金经理及美国纽约美联投资银行自营投资董事总经理，2008 年 6 月加入南方基金，现任南方基金数量化投资部总监。2010 年 3 月至今，任南方策略基金经理。

注：1. “任职日期”为基金合同生效日。

2. “离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

3. 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合规守信情况的说明

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、《南方策略优化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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人没有管理与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 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。

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

南方策略优化上半年的投资操作主要体现在行业配置上和基准不做太多的偏离，选股上偏重价值因子，风格上偏重大、中盘股票。仓位操作上基本保持在 80%~90%之间。所以年初的股票市场从小盘、新兴到大盘，价值的风格转换对我们影响不是很大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年上半年，南方策略优化基金净值增长-5.15%，同期沪深 300 增长-2.69%，上证综指增长-1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为中国经济持续增长的势头在全球经济中还会是处于领先地位，通货膨胀有望平稳或下降。许多股市已非常接近历史估值底部，上升空间大于下行风险。在房地产投资受控的条件下，许多投资者会逐渐意识到股市应该是抗通胀的最好的投资渠道。

从量化投资角度讲，下半年我们认为市场会有一个相对上半年更好的表现。小盘，新兴行业股票可能会表现更突出。我们会侧重价值、成长上有优势的股票，也会在小盘股上有一定的权重配置。

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：本基金收益分配应遵循下列原则：每一基金份额享有同等分配权；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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，本基金于 2011 年 4 月 19 日进行了收益分配，每 10 份派 0.20 元。

§ 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：南方策略优化股票型证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	78,645,126.60	109,518,489.69
结算备付金		1,244,349.46	1,755,033.89
存出保证金		1,036,333.13	768,411.17
交易性金融资产	6.4.3.2	905,407,001.20	1,089,031,791.34
其中：股票投资		897,808,567.78	1,010,954,087.09
基金投资		-	-
债券投资		7,598,433.42	78,077,704.25
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		30,950,921.09	68,963,426.00
应收利息	6.4.3.5	24,931.66	2,689,344.07
应收股利		247,561.44	-
应收申购款		248,578.34	819,989.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		1,017,804,802.92	1,273,546,485.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		24,748,584.22	-
应付赎回款		498,827.75	409,353.09
应付管理人报酬		1,195,956.03	1,665,876.18
应付托管费		199,326.00	277,646.04

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	972,838.34	1,866,217.33
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	705,478.39	676,261.53
负债合计		28,321,010.73	4,895,354.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	1,094,876,086.03	1,305,262,233.96
未分配利润	6.4.3.10	-105,392,293.84	-36,611,102.42
所有者权益合计		989,483,792.19	1,268,651,131.54
负债和所有者权益总计		1,017,804,802.92	1,273,546,485.71

注：1、报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.904 元，基金份额总额 1,094,876,086.03 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：南方策略优化股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 3 月 30 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-30,711,366.58	-410,354,434.11
1. 利息收入		1,418,842.03	2,013,791.42
其中：存款利息收入	6.4.3.11	240,756.12	1,107,975.76
债券利息收入		971,145.90	536,018.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		206,940.01	369,796.95
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		26,297,805.71	-115,276,707.51
其中：股票投资收益	6.4.3.12	19,657,314.59	-122,636,038.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	799,410.89	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	5,841,080.23	7,359,331.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-58,684,892.75	-297,189,717.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	256,878.43	98,198.99
减：二、费用		14,066,966.31	12,191,022.13

1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	8,497,515.39	7,492,310.93
2. 托管费	6.4.5.2.2	1,416,252.53	1,248,718.50
3. 销售服务费	6.4.5.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.3.19	3,943,731.06	3,339,638.64
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.20	209,467.33	110,354.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-44,778,332.89	-422,545,456.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,778,332.89	-422,545,456.24

注：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：南方策略优化股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	1,305,262,233.96	-36,611,102.42	1,268,651,131.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-44,778,332.89	-44,778,332.89
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）	-210,386,147.93	-1,812,071.39	-212,198,219.32
其中：1. 基金申购款	36,493,186.25	-1,341,021.18	35,152,165.07
2. 基金赎回款	-246,879,334.18	-471,050.21	-247,350,384.39
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）	-	-22,190,787.14	-22,190,787.14
五、期末所有者权益（基金净值）	1,094,876,086.03	-105,392,293.84	989,483,792.19
项目	上年度可比期间 2010 年 3 月 30 日至 2010 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)	2,173,254,149.88	-	2,173,254,149.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-422,545,456.24	-422,545,456.24
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)	-92,583,399.02	14,940,782.32	-77,642,616.70
其中：1. 基金申购款	1,113,791.85	-197,779.61	916,012.24
2. 基金赎回款	-93,697,190.87	15,138,561.93	-78,558,628.94
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)	2,080,670,750.86	-407,604,673.92	1,673,066,076.94

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：

高良玉

鲍文革

鲍文革

基金管理公司负责人

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 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	78,645,126.60
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	
合计：	78,645,126.60

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	896,173,294.41	897,808,567.78	1,635,273.37	
债券	交易所市场	6,844,300.00	7,598,433.42	754,133.42
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,844,300.00	7,598,433.42	754,133.42
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	903,017,594.41	905,407,001.20	2,389,406.79	

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

注：无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	15,711.31
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	560.00
应收债券利息	8,660.35

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	24,931.66

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	972,838.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	972,838.34

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	2,422.30
其他	200.00
预提费用	202,856.09
合计	705,478.39

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,305,262,233.96	1,305,262,233.96
本期申购	36,493,186.25	36,493,186.25
本期赎回(以“-”号填列)	-246,879,334.18	-246,879,334.18
_年_月_日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	1,094,876,086.03	1,094,876,086.03
-----	------------------	------------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-31,922,959.04	-4,688,143.38	-36,611,102.42
本期利润	13,906,559.86	-58,684,892.75	-44,778,332.89
本期基金份额交易产生的变动数	-916,434.15	-895,637.24	-1,812,071.39
其中：基金申购款	-209,952.62	-1,131,068.56	-1,341,021.18
基金赎回款	-706,481.53	235,431.32	-471,050.21
本期已分配利润	-22,190,787.14	-	-22,190,787.14
本期末	-41,123,620.47	-64,268,673.37	-105,392,293.84

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	220,485.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,703.84
其他	566.90
合计	240,756.12

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	1,331,577,817.17
减：卖出股票成本总额	1,311,920,502.58
买卖股票差价收入	19,657,314.59

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	135,261,166.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	130,852,060.00
减：应收利息总额	3,609,695.30
债券投资收益	799,410.89

6.4.3.14 衍生工具收益

注：无。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,841,080.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,841,080.23

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-58,684,892.75
——股票投资	-57,682,521.92
——债券投资	-1,002,370.83
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-58,684,892.75

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	253,127.06
转换费	3,751.37
合计	256,878.43

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	3,943,431.06
银行间市场交易费用	300.00
合计	3,943,731.06

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	2,111.24
账户维护费	9,000.00
合计	209,467.33

6.4.3.20 分部报告

无。

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（“南方基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年3月30日至2010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	1,245,170,933.10	48.72%	531,590,356.49	19.52%

6.4.5.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年3月30日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华泰证券	398,758.71	100.00%	-	-

6.4.5.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年3月30日至2010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	-	-	367,300,000.00	11.46%

6.4.5.1.2 权证交易

无余额。

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 2011年1月1日至2011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	1,011,691.25	47.66%	429,271.31	44.13%
关联方名称	上年度可比期间 2010年3月30日至2010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	435,974.62	19.18%	435,974.62	19.18%

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 2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 3 月 30 日 至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,497,515.39	7,492,310.93
其中：支付销售机构的客户维护费	2,888,508.96	2,489,075.98

注：支付基金管理人南方基金管理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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 3 月 30 日 至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,416,252.53	1,248,718.50

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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

份额单位：份

项目	本期 2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 3 月 30 日 至 2010 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2010 年 3 月 30 日）持有的基金份额	50,003,000.06	50,003,000.06
期初持有的基金份额	50,003,000.06	50,003,000.06

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	50,003,000.06	50,003,000.06
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.57%	2.40%

注：1、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。

6.4.5.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年3月30日至2010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
招商银行	78,645,126.60	220,485.38	255,149,954.18	1,075,811.38

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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。

6.4.6 利润分配情况

6.4.6.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每10份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2011-4-19	2011-4-19	2011-4-19	0.2000	17,791,706.58	4,399,080.56	22,190,787.14	
合计				0.2000	17,791,706.58	4,399,080.56	22,190,787.14	

6.4.7 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 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

6.4.7.1.1 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
000528	柳工	2011-1-21	2012-1-23	非公开发 行流通受 限	30.00	21.14	1,500,000	30,000,000.00	31,710,000.00	-

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。

6.4.7.2 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
601998	中信银行	2011-6-29	配股增发	4.75	2011-7-7	4.59	2,753,115	15,749,965.36	13,077,296.25	-
000876	新希望	2011-6-29	重大资产重组	19.95	2011-7-5	21.95	179,934	3,432,787.91	3,589,683.30	-
000652	泰达股份	2010-11-22	公告重大事项	7.68	2011-7-8	7.68	186,200	1,429,995.40	1,430,016.00	-

注：本基金截至 2011 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。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司总经理负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.8.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.8.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.7 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.8.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.8.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	78,645,126.60	-	-	-	78,645,126.60
结算备付金	1,244,349.46	-	-	-	1,244,349.46
存出保证金	-	-	-	1,036,333.13	1,036,333.13

交易性金融资产		4,832,689.92	2,765,743.50	897,808,567.78	905,407,001.20
应收证券清算款		-	-	30,950,921.09	30,950,921.09
应收利息		-	-	24,931.66	24,931.66
应收股利		-	-	247,561.44	247,561.44
应收申购款		-	-	248,578.34	248,578.34
资产总计	79,889,476.06	4,832,689.92	2,765,743.50	930,316,893.44	1,017,804,802.92
负债					
应付证券清算款		-	-	24,748,584.22	24,748,584.22
应付赎回款		-	-	498,827.75	498,827.75
应付管理人报酬		-	-	1,195,956.03	1,195,956.03
应付托管费		-	-	199,326.00	199,326.00
应付交易费用		-	-	972,838.34	972,838.34
其他负债		-	-	705,478.39	705,478.39
负债总计		-	-	28,321,010.73	28,321,010.73
利率敏感度缺口	79,889,476.06	4,832,689.92	2,765,743.50	901,995,882.71	989,483,792.19
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	109,518,489.69	-	-	-	109,518,489.69
结算备付金	1,755,033.89	-	-	-	1,755,033.89
存出保证金	-	-	-	768,411.17	768,411.17
交易性金融资产	70,138,000.00	1,311,177.45	6,628,526.80	1,010,954,087.09	1,089,031,791.34
应收证券清算款	-	-	-	68,963,426.00	68,963,426.00
应收利息	-	-	-	2,689,344.07	2,689,344.07
应收申购款	-	-	-	819,989.55	819,989.55
资产总计	181,411,523.58	1,311,177.45	6,628,526.80	1,084,195,257.88	1,273,546,485.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	409,353.09	409,353.09
应付管理人报酬	-	-	-	1,665,876.18	1,665,876.18
应付托管费	-	-	-	277,646.04	277,646.04
应付交易费用	-	-	-	1,866,217.33	1,866,217.33
其他负债	-	-	-	676,261.53	676,261.53
负债总计	-	-	-	4,895,354.17	4,895,354.17
利率敏感度缺口	181,411,523.58	1,311,177.45	6,628,526.80	1,079,299,903.71	1,268,651,131.54

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 (2011 年 6 月 30 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 25 个基点	增加约 9 万	成立尚未满一年
	市场利率上升 25 个基点	减少约 9 万	成立尚未满一年

6.4.8.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中，股票占基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具及其他金融工具占基金资产的 0-35%；权证占基金资产的 0-3%；资产支持证券占基金资产的 0-20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.8.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	897,808,567.78	90.74	1,010,954,087.09	79.69
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	897,808,567.78	90.74	1,010,954,087.09	79.69

6.4.8.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （ 2011 年 6 月 30 日 ）	上年度末 （ 2010 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 3867 万	成立尚未满一年
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 3867 万	成立尚未满一年

注：于 2010 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	897,808,567.78	88.21
	其中：股票	897,808,567.78	88.21
2	固定收益投资	7,598,433.42	0.75
	其中：债券	7,598,433.42	0.75
	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	79,889,476.06	7.85
6	其他各项资产	32,508,325.66	3.19
7	合计	1,017,804,802.92	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	7,841,220.60	0.79
B	采掘业	84,687,351.51	8.56
C	制造业	436,643,810.55	44.13
C0	食品、饮料	54,136,753.40	5.47

C1	纺织、服装、皮毛	5,205,028.00	0.53
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	41,142,595.69	4.16
C5	电子	13,499,382.21	1.36
C6	金属、非金属	94,673,958.21	9.57
C7	机械、设备、仪表	184,702,442.17	18.67
C8	医药、生物制品	43,283,650.87	4.37
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,226,708.47	1.24
E	建筑业	24,171,018.70	2.44
F	交通运输、仓储业	15,196,766.00	1.54
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	63,130,683.32	6.38
I	金融、保险业	144,280,339.74	14.58
J	房地产业	89,827,503.26	9.08
K	社会服务业	15,254,299.35	1.54
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,548,866.28	0.46
	合计	897,808,567.78	90.74

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000528	柳 工	1,500,000	31,710,000.00	3.20
2	000568	泸州老窖	422,415	19,059,364.80	1.93
3	601166	兴业银行	1,252,730	16,886,800.40	1.71
4	601601	中国太保	683,770	15,309,610.30	1.55
5	002024	苏宁电器	1,179,500	15,109,395.00	1.53
6	600585	海螺水泥	507,399	14,085,396.24	1.42
7	601318	中国平安	289,456	13,972,041.12	1.41
8	600875	东方电气	543,855	13,868,302.50	1.40
9	600252	中恒集团	707,881	13,173,665.41	1.33
10	000758	中色股份	370,010	13,079,853.50	1.32
11	601998	中信银行	2,753,115	13,077,296.25	1.32
12	600409	三友化工	1,012,942	11,750,127.20	1.19
13	000651	格力电器	498,900	11,724,150.00	1.18
14	000002	万 科A	1,378,600	11,649,170.00	1.18

15	600887	伊利股份	664,922	11,070,951.30	1.12
16	000039	中集集团	503,435	11,015,157.80	1.11
17	600166	福田汽车	1,251,700	10,864,756.00	1.10
18	600016	民生银行	1,870,316	10,716,910.68	1.08
19	000012	南玻A	633,286	10,449,219.00	1.06
20	000001	深发展A	601,450	10,266,751.50	1.04
21	600015	华夏银行	938,297	10,199,288.39	1.03
22	002142	宁波银行	915,405	9,959,606.40	1.01
23	000338	潍柴动力	219,040	9,950,987.20	1.01
24	000783	长江证券	913,882	9,842,509.14	0.99
25	600970	中材国际	360,000	9,838,800.00	0.99
26	600000	浦发银行	974,269	9,586,806.96	0.97
27	000728	国元证券	824,630	9,318,319.00	0.94
28	600031	三一重工	495,000	8,929,800.00	0.90
29	000612	焦作万方	476,999	8,509,662.16	0.86
30	600395	盘江股份	250,000	8,297,500.00	0.84
31	002321	华英农业	428,482	7,841,220.60	0.79
32	600546	山煤国际	250,000	7,797,500.00	0.79
33	600519	贵州茅台	35,000	7,442,050.00	0.75
34	000024	招商地产	400,755	7,333,816.50	0.74
35	600690	青岛海尔	255,500	7,141,225.00	0.72
36	600362	江西铜业	200,200	7,095,088.00	0.72
37	002001	新和成	238,999	7,038,520.55	0.71
38	600376	首开股份	520,128	6,870,890.88	0.69
39	000939	凯迪电力	532,394	6,835,938.96	0.69
40	000729	燕京啤酒	400,000	6,788,000.00	0.69
41	000858	五粮液	173,200	6,186,704.00	0.63
42	600835	上海机电	513,383	6,073,320.89	0.61
43	000932	华菱钢铁	1,475,974	6,066,253.14	0.61
44	600765	中航重机	400,035	6,000,525.00	0.61
45	600007	中国国贸	655,811	5,954,763.88	0.60
46	000999	华润三九	330,391	5,930,518.45	0.60
47	600549	厦门钨业	142,460	5,902,117.80	0.60
48	601111	中国国航	605,800	5,809,622.00	0.59
49	601008	连云港	580,740	5,807,400.00	0.59
50	601169	北京银行	579,480	5,777,415.60	0.58
51	000623	吉林敖东	187,506	5,777,059.86	0.58
52	600739	辽宁成大	202,950	5,642,010.00	0.57
53	600256	广汇股份	233,647	5,556,125.66	0.56

54	601958	金钼股份	285,145	5,489,041.25	0.55
55	002207	准油股份	315,850	5,312,597.00	0.54
56	000573	粤宏远 A	1,009,400	5,299,350.00	0.54
57	600862	南通科技	409,210	5,217,427.50	0.53
58	002225	濮耐股份	400,450	5,193,836.50	0.52
59	600128	弘业股份	314,400	5,131,008.00	0.52
60	600637	广电信息	397,982	4,954,875.90	0.50
61	601666	平煤股份	351,000	4,917,510.00	0.50
62	600983	合肥三洋	411,711	4,911,712.23	0.50
63	002053	云南盐化	383,159	4,881,445.66	0.49
64	000062	深圳华强	590,963	4,828,167.71	0.49
65	002133	广宇集团	856,600	4,805,526.00	0.49
66	600184	光电股份	134,900	4,767,366.00	0.48
67	600135	乐凯胶片	304,198	4,760,698.70	0.48
68	600187	国中水务	359,421	4,726,386.15	0.48
69	000830	鲁西化工	666,000	4,662,000.00	0.47
70	601699	潞安环能	140,800	4,619,648.00	0.47
71	000025	特力 A	448,351	4,618,015.30	0.47
72	000425	徐工机械	185,820	4,606,477.80	0.47
73	000517	荣安地产	528,976	4,559,773.12	0.46
74	600051	宁波联合	321,702	4,548,866.28	0.46
75	600302	标准股份	580,799	4,541,848.18	0.46
76	002380	科远股份	125,466	4,491,682.80	0.45
77	000526	旭飞投资	377,750	4,476,337.50	0.45
78	000671	阳光城	534,310	4,466,831.60	0.45
79	600346	大橡塑	366,766	4,434,200.94	0.45
80	002398	建研集团	219,265	4,426,960.35	0.45
81	600679	金山开发	413,393	4,386,099.73	0.44
82	600367	红星发展	243,990	4,382,060.40	0.44
83	600738	兰州民百	474,000	4,346,580.00	0.44
84	600660	福耀玻璃	417,110	4,321,259.60	0.44
85	600123	兰花科创	102,800	4,294,984.00	0.43
86	002122	天马股份	334,165	4,277,312.00	0.43
87	600432	吉恩镍业	190,271	4,239,237.88	0.43
88	600768	宁波富邦	330,300	4,211,325.00	0.43
89	600971	恒源煤电	102,800	4,149,008.00	0.42
90	002212	南洋股份	461,442	4,116,062.64	0.42
91	002059	云南旅游	360,000	4,111,200.00	0.42
92	600322	天房发展	764,500	4,059,495.00	0.41

93	000937	冀中能源	158,400	4,015,440.00	0.41
94	000961	中南建设	380,310	4,008,467.40	0.41
95	601899	紫金矿业	551,300	3,991,412.00	0.40
96	002391	长青股份	217,573	3,979,410.17	0.40
97	600478	科力远	188,501	3,962,291.02	0.40
98	002305	南国置业	649,036	3,926,667.80	0.40
99	002149	西部材料	207,609	3,905,125.29	0.39
100	002254	烟台氨纶	216,834	3,868,318.56	0.39
101	000721	西安饮食	384,252	3,865,575.12	0.39
102	000581	威孚高科	100,000	3,855,000.00	0.39
103	600866	星湖科技	373,130	3,850,701.60	0.39
104	000151	中成股份	359,200	3,839,848.00	0.39
105	002062	宏润建设	344,383	3,822,651.30	0.39
106	002356	浩宁达	158,944	3,811,477.12	0.39
107	000925	众合机电	220,309	3,806,939.52	0.38
108	600812	华北制药	330,200	3,803,904.00	0.38
109	002087	新野纺织	761,800	3,778,528.00	0.38
110	000416	民生投资	518,900	3,736,080.00	0.38
111	600647	同达创业	296,600	3,716,398.00	0.38
112	000020	深华发A	452,660	3,716,338.60	0.38
113	600523	贵航股份	195,049	3,715,683.45	0.38
114	000608	阳光股份	679,420	3,709,633.20	0.37
115	600253	天方药业	481,100	3,709,281.00	0.37
116	600512	腾达建设	750,000	3,682,500.00	0.37
117	600110	中科英华	564,200	3,622,164.00	0.37
118	000983	西山煤电	149,114	3,608,558.80	0.36
119	600348	阳泉煤业	149,200	3,601,688.00	0.36
120	000876	新希望	179,934	3,589,683.30	0.36
121	600029	南方航空	456,600	3,579,744.00	0.36
122	600266	北京城建	235,200	3,539,760.00	0.36
123	600416	湘电股份	289,959	3,511,403.49	0.35
124	601088	中国神华	113,800	3,429,932.00	0.35
125	000540	中天城投	204,800	3,411,968.00	0.34
126	601398	工商银行	742,400	3,311,104.00	0.33
127	600997	开滦股份	205,200	3,274,992.00	0.33
128	600858	银座股份	160,000	3,270,400.00	0.33
129	000768	西飞国际	291,800	3,212,718.00	0.32
130	601600	中国铝业	290,400	3,197,304.00	0.32
131	000527	美的电器	172,600	3,174,114.00	0.32

132	601988	中国银行	995,600	3,126,184.00	0.32
133	601898	中煤能源	306,000	3,060,000.00	0.31
134	600320	振华重工	443,600	2,949,940.00	0.30
135	600837	海通证券	324,800	2,929,696.00	0.30
136	601003	柳钢股份	550,000	2,882,000.00	0.29
137	000031	中粮地产	502,200	2,872,584.00	0.29
138	000677	山东海龙	625,500	2,858,535.00	0.29
139	600748	上实发展	391,400	2,833,736.00	0.29
140	002307	北新路桥	170,000	2,818,600.00	0.28
141	600027	华电国际	830,000	2,755,600.00	0.28
142	600886	国投电力	380,000	2,755,000.00	0.28
143	601918	国投新集	222,800	2,709,248.00	0.27
144	600122	宏图高科	422,000	2,645,940.00	0.27
145	600663	陆家嘴	188,000	2,628,240.00	0.27
146	000877	天山股份	64,000	2,274,560.00	0.23
147	600461	洪城水业	189,859	1,989,722.32	0.20
148	000417	合肥百货	88,000	1,601,600.00	0.16
149	000652	泰达股份	186,200	1,430,016.00	0.14
150	002029	七匹狼	45,000	1,426,500.00	0.14
151	000630	铜陵有色	55,038	1,326,415.80	0.13
152	002033	丽江旅游	50,000	1,007,000.00	0.10
153	002242	九阳股份	74,467	930,837.50	0.09
154	601126	四方股份	5,396	98,908.68	0.01

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 名的权益投资明细

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	000528	柳工	30,000,000.00	2.36
2	600252	中恒集团	19,364,439.36	1.53
3	000568	泸州老窖	18,884,476.38	1.49
4	002024	苏宁电器	15,124,506.68	1.19
5	002310	东方园林	14,646,268.98	1.15
6	600875	东方电气	13,897,198.77	1.10
7	600887	伊利股份	12,767,908.86	1.01
8	600585	海螺水泥	12,125,758.42	0.96

9	000002	万科 A	11,867,296.78	0.94
10	600409	三友化工	11,767,122.68	0.93
11	000651	格力电器	11,710,516.91	0.92
12	600546	山煤国际	10,505,174.20	0.83
13	000979	中弘地产	9,861,843.48	0.78
14	600239	云南城投	9,076,064.39	0.72
15	002261	拓维信息	8,614,784.87	0.68
16	002051	中工国际	8,607,274.17	0.68
17	002290	禾盛新材	8,423,376.94	0.66
18	600395	盘江股份	8,397,536.00	0.66
19	002321	华英农业	8,386,222.58	0.66
20	600031	三一重工	8,175,580.23	0.64

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 名的权益投资明细

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	000997	新大陆	13,875,132.85	1.09
2	600694	大商股份	13,235,270.83	1.04
3	601727	上海电气	12,891,897.32	1.02
4	000897	津滨发展	12,409,442.43	0.98
5	600576	万好万家	12,320,556.58	0.97
6	002310	东方园林	12,163,544.32	0.96
7	002192	路翔股份	11,643,462.57	0.92
8	000848	承德露露	11,210,832.43	0.88
9	002253	川大智胜	10,386,934.80	0.82
10	600992	贵绳股份	10,383,275.10	0.82
11	000795	太原刚玉	10,134,683.14	0.80
12	600990	四创电子	10,105,354.24	0.80
13	000009	中国宝安	9,890,025.70	0.78
14	600970	中材国际	9,881,210.80	0.78
15	600400	红豆股份	9,860,255.41	0.78
16	000717	韶钢松山	9,494,530.33	0.75
17	000966	长源电力	9,332,770.56	0.74

18	600741	华域汽车	9,325,432.11	0.74
19	600146	大元股份	8,858,550.40	0.70
20	600812	华北制药	8,855,298.37	0.70

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	1,256,457,505.19
卖出股票收入（成交）总额	1,331,577,817.17

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	7,598,433.42	0.77
8	其他	-	-
9	合计	7,598,433.42	0.77

7.6 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

金额单位：人民币元

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（%）
1	113001	中行转债	37,830	3,994,091.40	0.40
2	110013	国投转债	12,960	1,546,516.80	0.16
3	126729	燕京转债	6,613	813,610.62	0.08
4	110015	石化转债	4,730	510,130.50	0.05
5	113002	工行转债	3,470	411,090.90	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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名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 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,036,333.13
2	应收证券清算款	30,950,921.09
3	应收股利	247,561.44
4	应收利息	24,931.66
5	应收申购款	248,578.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,508,325.66

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	3,994,091.40	0.40
2	126729	燕京转债	813,610.62	0.08
3	113002	工行转债	411,090.90	0.04
4	110011	歌华转债	298,005.30	0.03

7.9.5 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	-----------	----------	----------

			价值	例 (%)	
1	000528	柳 工	31,710,000.00	3.20	非公开发行

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
25,772	42,483.16	110,042,040.47	10.05%	984,834,045.56	89.95%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人 员持有本开放式基金	522,540.89	0.0477%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,305,262,233.96
本报告期基金总申购份额	36,493,186.25
减：本报告期基金总赎回份额	246,879,334.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,094,876,086.03

§ 10 重大事件揭示

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 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部发生如下重大人事变动：根据招银发[2011]331号文，夏博辉先生不再担任本基金托管行资产托管部总经理职务，本基金托管行已聘任吴晓辉先生

担任资产托管部负责人。

本报告期后基金管理人发生如下重大人事变动：2011 年 8 月 16 日，基金管理人发布公告，聘任朱运东为公司副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		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	
华泰证券	2	1,245,170,933.10	48.72%	1,011,691.25	47.66%	-
银河证券	1	771,799,733.93	30.20%	656,029.04	30.91%	-
华创证券	1	443,112,985.25	17.34%	376,645.16	17.74%	-
广发证券	1	79,999,427.66	3.13%	65,000.02	3.06%	-
中投证券	1	15,681,263.06	0.61%	13,328.95	0.63%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：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的选择标准和程序：

A：选择标准

a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

b、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

c、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

d、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择交易单元:

a、服务的主动性。主要针对证券公司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;

b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	398,758.71	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金参加渤海银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年6月30日
2	南方基金关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年6月30日

3	南方基金关于旗下部分基金参加中信银行个人网银、移动银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 6 月 30 日
4	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加渤海银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 6 月 22 日
5	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 6 月 22 日
6	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加哈尔滨银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 6 月 21 日
7	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加乌鲁木齐市商业银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 6 月 21 日
8	南方基金关于旗下基金在中国工商银行开通基金定投业务并参加定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 6 月 20 日
9	南方基金关于开通网上直销赎回转认/申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 6 月 15 日
10	南方基金关于暂停中国银行广东省分行银行卡网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 5 月 26 日
11	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加东莞农村商业银行作为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 5 月 25 日
12	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 5 月 11 日
13	关于公司旗下基金持有停牌股票恢复使用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 4 月 21 日
14	南方策略优化股票型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 4 月 15 日
15	南方基金关于旗下部分基金参加东莞银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 4 月 1 日
16	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 4 月 1 日
17	南方基金关于旗下部分基金参加华夏银行延长基金定	中国证券报、上海证	2011 年 4 月 1 日

	投申购费率优惠活动的公告	券报、证券时报	
18	南方基金关于旗下部分基金参加“华夏银行盈基金 2011”网上银行基金申购 4 折优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 4 月 1 日
19	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 3 月 22 日
20	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加重庆银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 3 月 21 日
21	南方基金关于旗下部分基金参加汉口银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 3 月 15 日
22	南方基金关于旗下基金在天相投顾推出基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 3 月 15 日
23	南方基金关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 3 月 11 日
24	南方基金关于旗下部分基金参加温州银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 1 月 31 日
25	南方基金管理有限公司关于开通基金电话交易的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 1 月 28 日
26	南方基金关于旗下基金获配柳工（000528）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 1 月 25 日
27	南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加深圳农村商业银行作为代销机构的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2011 年 1 月 12 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方策略优化股票型证券投资基金的文件。
- 2、《南方策略优化股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《南方策略优化股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《南方策略优化股票型证券投资基金 2011 年半年度报告》原文
- 5、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。

6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>