

# 南方绩优成长股票型证券投资基金 2013 年 年度报告

2013 年 12 月 31 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

送出日期：2014 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 3 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。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 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.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
8.6 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.....	46
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	46
8.8 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.....	46

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	46
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
8.11 投资组合报告附注 .....	46
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
11.2 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 .....	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
11.4 基金投资策略的改变 .....	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
11.8 其他重大事件 .....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方绩优成长股票型证券投资基金
基金简称	南方绩优成长股票
基金主代码	202003
前端交易代码	202003
后端交易代码	202004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 16 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	6,110,266,014.79 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“南方绩优”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，根据对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡与精选，力争为投资者寻求超越基准的投资回报与长期稳健的资产增值。
投资策略	<p>本基金的股票投资主要采用“自下而上”的策略，通过对上市公司基本面的深入研究，基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡，不仅重视公司的业绩与成长性，更注重公司的业绩与成长性的质量，精选中长期持续增长或未来阶段性高速增长、业绩质量优秀、且价值被低估的绩优成长股票作为主要投资对象。本基金的股票投资同时结合“自上而下”的行业分析，根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以最低的组合风险精选并确定最优质的股票组合。</p> <p>本基金将优先选择具有良好的行业增长空间，所处行业结构相对稳定，在产业链中处于优势地位或上下游运行态势好转，具有一定的垄断竞争优势，公司治理结构透明完善，管理水平领先的上市公司。</p>
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	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
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		吴万善	姜建清

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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 6 号免税商务大厦塔楼 31-33 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	594,014,658.05	-479,205,880.81	-1,060,206,308.98
本期利润	1,098,185,280.06	557,077,007.33	-2,492,211,125.40
加权平均基金份额本期利润	0.1709	0.0784	-0.3124
本期加权平均净值利润率	13.75%	7.24%	-25.12%
本期基金份额净值增长率	14.59%	7.46%	-23.26%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末

期末可供分配利润	-605,137,731.04	-1,311,744,610.28	-942,066,493.80
期末可供分配基金份额利润	-0.0990	-0.1918	-0.1239
期末基金资产净值	7,873,894,134.42	7,689,980,382.74	7,953,270,580.35
期末基金份额净值	1.2886	1.1245	1.0464
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	135.38%	105.41%	91.14%

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。

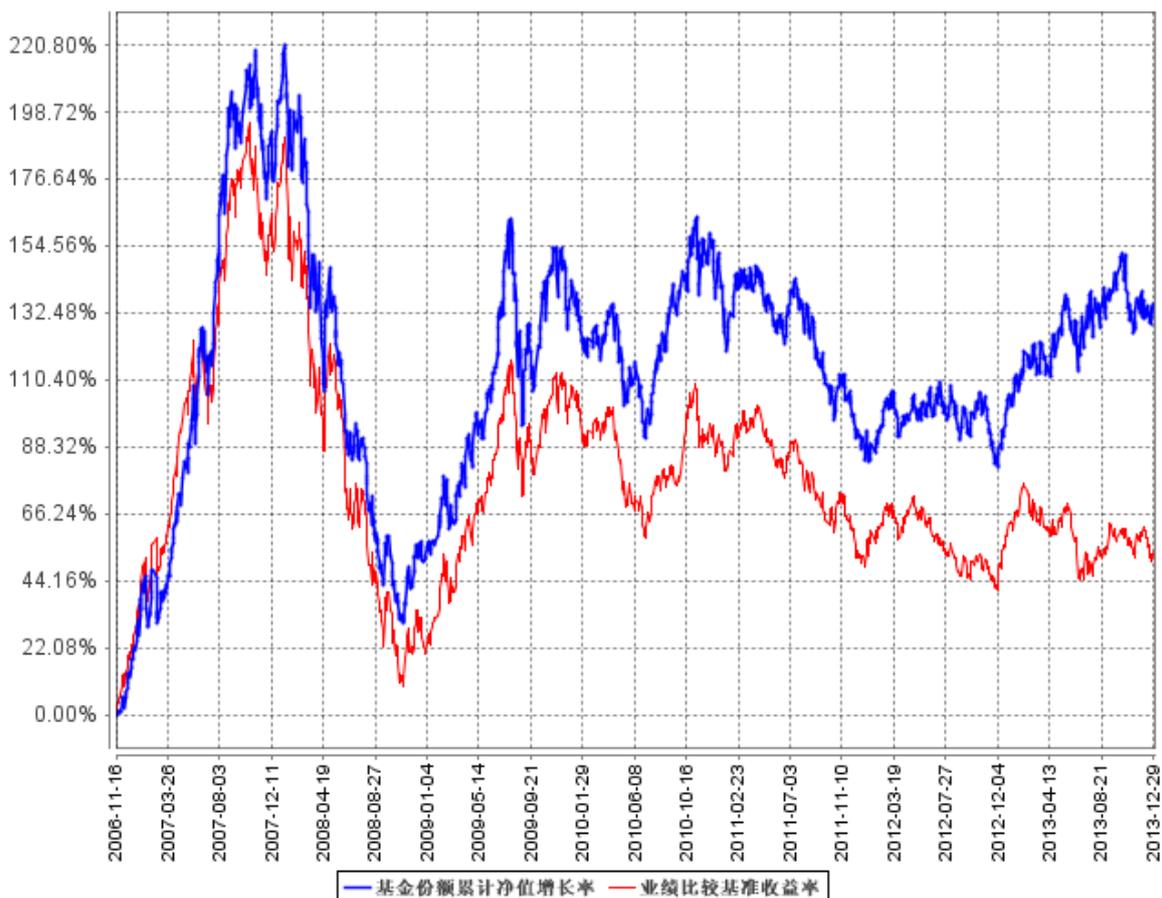
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	-3.91%	1.17%	-2.45%	0.90%	-1.46%	0.27%
过去六个月	7.61%	1.28%	5.06%	1.03%	2.55%	0.25%
过去一年	14.59%	1.30%	-5.30%	1.11%	19.89%	0.19%
过去三年	-5.50%	1.15%	-18.57%	1.06%	13.07%	0.09%
过去五年	54.31%	1.37%	28.47%	1.24%	25.84%	0.13%
自基金合同生效起至今	135.38%	1.61%	54.31%	1.57%	81.07%	0.04%

### 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

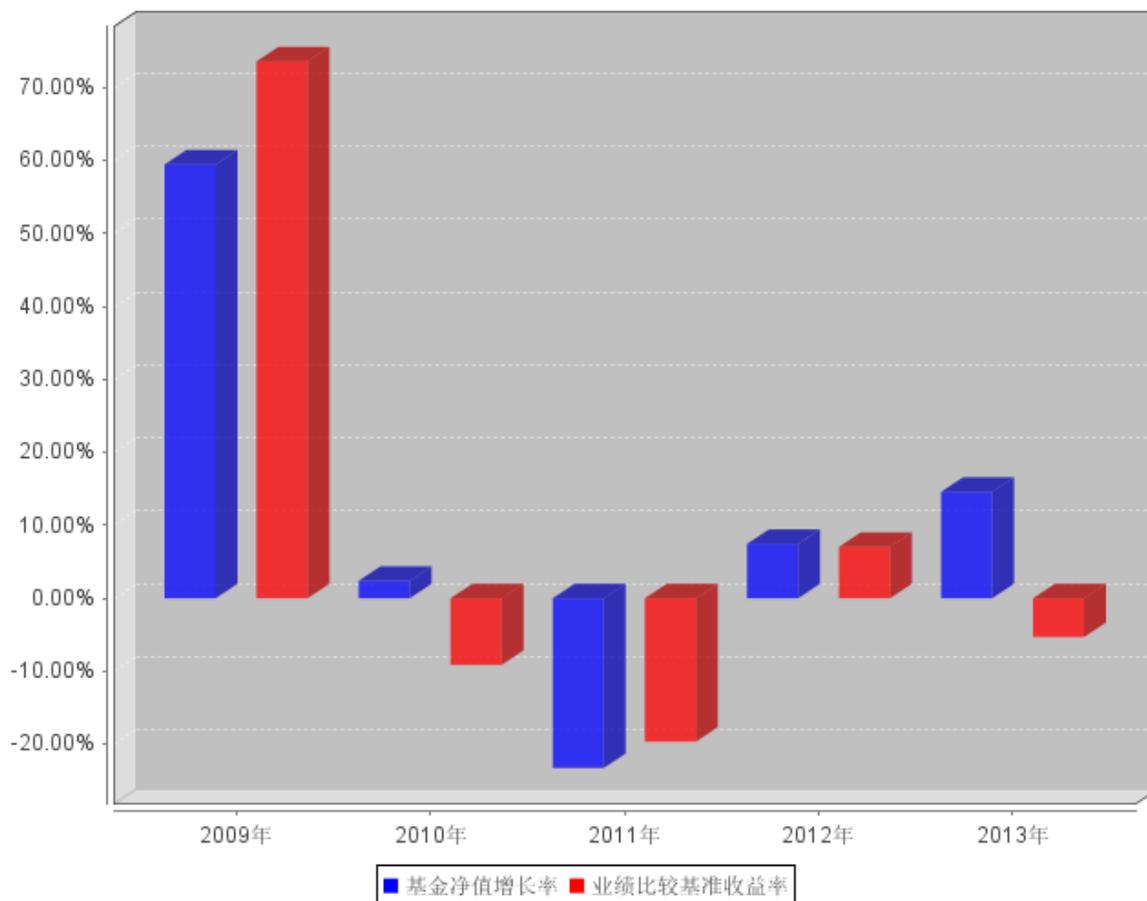
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据相关法律法规，本基金建仓期为基金合同生效之日起 3 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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2013	-	-	-	-	
2012	-	-	-	-	
2011	1.0670	288,501,988.37	564,348,555.96	852,850,544.33	
合计	1.0670	288,501,988.37	564,348,555.96	852,850,544.33	

## § 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 2,300 亿元，旗下管理 45 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		
张原	本基金的基金经理	2010年2月12日	-	7	美国密歇根大学经济学硕士学位，具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金，曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员，南方高增及南方隆元基金经理助理；2009年9月至2013年4月，任南方500基金经理；2010年2月至今，任南方绩优基金经理；2011年2月至今，任南方高增基金经理。
史博	本基金的基金经理、公司研究部总监	2011年2月17日	-	15	特许金融分析师（CFA），硕士学历，具有基金从业资格。曾任职于博时基金管理有限公司、中国人寿资产管理有限公司、泰达宏利基金管理有限公司。2004年7月-2005年2月，任泰达周期基金经理；2007年7月-2009年5月任泰达首选基金经理；2008年8月-2009年9月任泰达市值基金经理；2009年4月-2009年9月任泰达品质基金经理。2009年10月加入南方基金，现任南方基金研究部总监、投资决策委员会委员。2011年2月至今，任南方绩优基金经理。
熊琳	本基金的基金经理助理	2012年3月15日	-	7	上海财经大学财务管理硕士，具有基金从业资格；曾担任中投证券研究所资深分析师，并获得新财富排名第六；2010年5月加入南方基金，担任研究部电子设备及新能源行业高级研究员；2012年3月至今，任南方绩优基金经理助理。

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，除非首任基金经理外，“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、《南方绩优成长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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，制定了研究报告审核流程，股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资决策委员会议事规则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 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。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，不存在不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 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

2013 年，我国经济增长跌宕起伏，A 股市场的表现更多受到国内因素的影响，并主要由改革预期推动。年初市场对新一届班子改革政策和改革红利以及对城镇化等主题充满了憧憬，但随着主要经济指标低于年初投资者预期，呈现先抑后扬的态势。在稳增长措施和企业补库存的推动下，从三季度开始，我国各项经济指标才出现环比回暖，四季度陆续出台的宏观数据表明经济增速仍属于温和复苏，随着十八届三中全会决议的公布，市场信心扭转向上。行业表现上，2013 年成长股大幅上涨，创业板指数上涨 82.73%，主板则受地产、金融板块影响表现落后，结构性行情依然明显。

回顾 2013 年全年的操作，我们在仓位和持仓结构上较好地注重了控制，继续优化行业配置及个股组合。保持电子、计算机等成长行业的高配置，精选政策受益行业及个股投资机会，并继续关注盈利增长稳定和业绩超预期的公司，总体上述操作对基金绩效带来正面效果。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013 年全年，南方绩优成长基金净值增长 14.59%，同期基金基准增长-5.30%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中长期来看，由于我国经济发展过程中积累的深层次问题和矛盾越来越突出，经济结构调整将比较漫长，既有第二产业整体产能过剩所倒逼的产业内部转型升级，又有第二、三产业之间正在稳步引导推进的产业结构比例优化。同时，企业经营也呈现出一些新的趋势性特点，生产要素中各要素成本刚性上升制约了简单的规模化扩张，资金要素对企业盈利的影响越来越明显，竞争所面临的外部环境随时有可能受到创新性、颠覆性商业模式的冲击。在经济增长达到一种新的平衡之前，企业经营将可能呈现出不同产业间结构化分化、企业内部经营逆转或形成新的增长点等多种模式和特点。鉴于此，未来 3-5 年，我们将更多的精力放在寻找结构、板块行情和规避阶段性下跌、把握阶段性上行的机会上。

整体看好 2014 年机会，但是很难出现系统性行情。外围发达经济体市场持续复苏势头确立，国内宏观政策受调结构的影响，市场风险偏好可能会随着三中全会决议逐步实施所带来的改革红利显著提升。但不同于往年的是，新兴国家货币市场风险正在积累，我国宏观调控底线思维带来的政策变动，将使市场投资者不断被动调整预期。企业所面临宏观经济形势的复杂性仍将对企业盈利的回升构成压力，并显著分化不同产业、不同行业间微观企业的盈利表现。

投资思路，2014 年我们将重点优选相对确定性高、真正具有成长性的个股投资机会，同时

关注受益于经济转型、竞争力不断提升地中游制造业，注重观察市场可能发生的冲击而保持灵活仓位，努力为持有人创造超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

##### (1) 开展多项内控自查工作，进一步完善公司各项内部管理制度

本年度以法律法规、监管要求为导向，开展了基金管理公司内控自查、ETF 和固定收益投资运作风险自查等多项内控自查工作以及永泰能源超比例换购事件的整改工作，同时结合外聘会计师对公司内控进行的审计以及公司运作实务，监察稽核部积极督促并配合各业务部门根据法律法规、公司制度和业务实际情况，修订完善相关制度和业务流程，进一步完善了公司内控制度，达到更好地防范风险的目的。此外，根据中国证监会《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》的要求，制定了《南方基金防控内幕信息及交易管理制度》，进一步完善了内幕交易的防控机制。

##### (2) 定期监察稽核工作与专项稽核工作相结合

按照证监会的要求对公司投资、研究、交易、信息技术、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对投资研究、基金直销、后台运营、反洗钱、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

##### (4) 对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训

本年度，我公司采取外聘专家和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我司从业人员的合规素质和职业道德修养。

##### (5) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极

参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

#### (6) 信息披露和投资者关系管理工作

完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(7) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并开发了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

### 4.7 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，组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部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。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。

### 4.8 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 90%，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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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

2013 年，本基金托管人在对南方绩优成长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

2013 年，南方绩优成长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绩优成长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。

### 5.3 托管人对本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绩优成长股票型证券投资基金 2013 年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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2014)第 21236 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方绩优成长股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的南方绩优成长股票型证券投资基金(以下简称“南方绩优成长基金”)的财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错

	<p>报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述南方绩优成长基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了南方绩优成长基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	汪 棣 陈 熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2014 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：南方绩优成长股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	631,985,447.64	441,475,775.06
结算备付金		14,976,275.27	3,236,512.74
存出保证金		4,371,547.16	3,140,539.81
交易性金融资产	7.4.7.2	6,626,242,507.35	7,248,794,538.94
其中：股票投资		6,152,983,964.85	6,991,685,354.94
基金投资		-	-
债券投资		473,258,542.50	257,109,184.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	498,721,668.09	-
应收证券清算款		113,565,787.40	14,687,591.17
应收利息	7.4.7.5	5,584,149.12	1,282,232.10
应收股利		28,000.00	-
应收申购款		1,617,661.79	477,541.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		7,897,093,043.82	7,713,094,731.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2012 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,742,589.79	5,849,575.04
应付管理人报酬		9,975,920.96	9,158,215.10
应付托管费		1,662,653.48	1,526,369.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,575,230.34	4,882,502.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	242,514.83	1,697,686.63
负债合计		23,198,909.40	23,114,348.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	6,110,266,014.79	6,838,438,121.92
未分配利润	7.4.7.10	1,763,628,119.63	851,542,260.82
所有者权益合计		7,873,894,134.42	7,689,980,382.74
负债和所有者权益总计		7,897,093,043.82	7,713,094,731.26

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2886 元，基金份额总额 6,110,266,014.79 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方绩优成长股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,290,015,355.47	725,045,612.89
1. 利息收入		27,604,012.97	21,584,184.81
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,647,092.14	5,228,048.46
债券利息收入		12,756,172.60	12,923,345.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,200,748.23	3,432,791.14
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		757,727,323.63	-333,196,512.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	684,757,690.51	-397,705,768.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,829,864.58	764,294.60
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	68,139,768.54	63,744,961.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	504,170,622.01	1,036,282,888.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	513,396.86	375,052.51
<b>减：二、费用</b>		191,830,075.41	167,968,605.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	119,820,561.82	115,510,283.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	19,970,093.67	19,251,713.81
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	51,571,417.93	32,737,707.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	468,001.99	468,900.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,098,185,280.06	557,077,007.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,098,185,280.06	557,077,007.33

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方绩优成长股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	6,838,438,121.92	851,542,260.82	7,689,980,382.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,098,185,280.06	1,098,185,280.06
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）	-728,172,107.13	-186,099,421.25	-914,271,528.38
其中：1. 基金申购款	351,238,096.27	91,783,215.98	443,021,312.25
2. 基金赎回款	-1,079,410,203.40	-277,882,637.23	-1,357,292,840.63
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）	6,110,266,014.79	1,763,628,119.63	7,873,894,134.42
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	7,600,775,903.06	352,494,677.29	7,953,270,580.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	557,077,007.33	557,077,007.33
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）	-762,337,781.14	-58,029,423.80	-820,367,204.94
其中：1. 基金申购款	137,189,372.84	10,972,816.86	148,162,189.70
2. 基金赎回款	-899,527,153.98	-69,002,240.66	-968,529,394.64
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）	6,838,438,121.92	851,542,260.82	7,689,980,382.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨小松</u>	<u>邓见梁</u>	<u>邓见梁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方绩优成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 224 号《关于同意南方绩优成长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方绩优成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 12,476,919,237.63 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2006)第 173 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方绩优成长股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 12,477,494,128.02 份基金份额,其中认购资金利息折合 574,890.39 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方绩优成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法公开发行、

上市的股票和债券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金组合投资的范围中股票占基金资产净值的 60%-95%，其中对绩优成长股票的投资不低于股票投资比例的 80%；现金、债券、货币市场工具以及权证等其他金融工具占基金资产净值的 5%-40%，其中基金保留的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%。本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2014 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方绩优成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金 2013 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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。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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	631,985,447.64	441,475,775.06
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	631,985,447.64	441,475,775.06

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,846,132,452.27	6,152,983,964.85	1,306,851,512.58	
债券	交易所市场	53,373,000.00	57,242,542.50	3,869,542.50
	银行间市场	416,160,490.00	416,016,000.00	-144,490.00
	合计	469,533,490.00	473,258,542.50	3,725,052.50
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	5,315,665,942.27	6,626,242,507.35	1,310,576,565.08	
项目	上年度末 2012 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	

股票		6,186,259,895.87	6,991,685,354.94	805,425,459.07
债券	交易所市场	6,540,000.00	7,649,184.00	1,109,184.00
	银行间市场	249,588,700.00	249,460,000.00	-128,700.00
	合计	256,128,700.00	257,109,184.00	980,484.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,442,388,595.87	7,248,794,538.94	806,405,943.07

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	498,721,668.09	-
合计	498,721,668.09	-
项目	上年度末 2012年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	-	-
合计	-	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无余额。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应收活期存款利息	182,766.17	89,179.87
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	6,739.30	1,456.40
应收债券利息	5,188,483.87	1,191,595.83
应收买入返售证券利息	204,192.58	-
应收申购款利息	-	-

其他	1,967.20	-
合计	5,584,149.12	1,282,232.10

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,552,251.34	4,877,371.61
银行间市场应付交易费用	22,979.00	5,130.97
合计	4,575,230.34	4,882,502.58

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	1,250,000.00
应付赎回费	5,514.83	6,186.63
预提费用	237,000.00	441,500.00
合计	242,514.83	1,697,686.63

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	6,838,438,121.92	6,838,438,121.92
本期申购	351,238,096.27	351,238,096.27
本期赎回(以“-”号填列)	-1,079,410,203.40	-1,079,410,203.40
- 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	6,110,266,014.79	6,110,266,014.79

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 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	-1,311,744,610.28	2,163,286,871.10	851,542,260.82
本期利润	594,014,658.05	504,170,622.01	1,098,185,280.06
本期基金份额交易产生的变动数	112,592,221.19	-298,691,642.44	-186,099,421.25
其中：基金申购款	-40,250,396.54	132,033,612.52	91,783,215.98
基金赎回款	152,842,617.73	-430,725,254.96	-277,882,637.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-605,137,731.04	2,368,765,850.67	1,763,628,119.63

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
活期存款利息收入	5,352,131.59	5,087,200.21
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	290,595.24	140,725.33
其他	4,365.31	122.92
合计	5,647,092.14	5,228,048.46

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
卖出股票成交总额	17,816,212,325.70	10,883,246,169.46
减：卖出股票成本总额	17,131,454,635.19	11,280,951,938.39
买卖股票差价收入	684,757,690.51	-397,705,768.93

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	368,397,869.80	817,234,237.68
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	354,461,320.00	791,224,230.00
减:应收利息总额	9,106,685.22	25,245,713.08
债券投资收益	4,829,864.58	764,294.60

#### 7.4.7.14 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
股票投资产生的股利收益	68,139,768.54	63,744,961.76
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	68,139,768.54	63,744,961.76

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
1. 交易性金融资产	504,170,622.01	1,036,282,888.14
——股票投资	501,426,053.51	1,036,061,214.14
——债券投资	2,744,568.50	221,674.00
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	504,170,622.01	1,036,282,888.14

#### 7.4.7.16 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
基金赎回费收入	159,316.59	364,227.76
其他	295,789.22	-
转换费	58,291.05	10,824.75
合计	513,396.86	375,052.51

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	51,569,467.93	32,734,982.38
银行间市场交易费用	1,950.00	2,725.00
合计	51,571,417.93	32,737,707.38

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
审计费用	137,000.00	137,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他	60.00	-
银行汇划费	21,941.99	13,900.84
账户维护费	9,000.00	18,000.00
合计	468,001.99	468,900.84

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 7.4.9 关联方关系

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

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
厦门国际信托有限公司(“厦门信托”)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	1,727,079,303.17	5.18%	2,289,116,506.36	10.69%
兴业证券	2,319,577,145.25	6.95%	515,542,199.27	2.41%

#### 7.4.10.1.2 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12月31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	1,531,881.46	5.11%	-	-
兴业证券	2,052,597.00	6.85%	242,987.66	5.34%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	2,026,995.49	10.97%	686,704.18	14.08%
兴业证券	438,708.12	2.37%	219,572.14	4.50%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	119,820,561.82	115,510,283.53
其中：支付销售机构的客户维护费	14,550,156.73	13,917,547.63

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,970,093.67	19,251,713.81

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。

### 7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

无。

### 7.4.10.4 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		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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	631,985,447.64	5,352,131.59	441,475,775.06	5,087,200.21

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。

### 7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002236	大华股份	2013 年 5 月 29 日	2014 年 5 月 31 日	非公开发行流通受限	33.60	37.93	6,000,000	201,600,000.00	227,580,000.00	-
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	8.55	4,000,000	30,200,000.00	34,200,000.00	-

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。

##### 7.4.12.2 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
600686	金龙汽车	2013 年 11 月 18 日	重大事项未公告	8.91	2014 年 3 月 20 日	9.60	15,600,000	112,504,589.31	138,996,000.00	-
300012	华测检测	2013 年 11 月 15 日	公告重大事项	16.15	2014 年 1 月 23 日	17.77	1,596,936	23,174,466.71	25,790,516.40	-

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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、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，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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。

#### 7.4.13.2 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，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.73%(2012 年 12 月 31 日：0.10%)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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 7.4.12 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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，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。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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、存出保证金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本年末 2013年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	631,985,447.64	-	-	-	631,985,447.64
结算备付金	14,976,275.27	-	-	-	14,976,275.27
存出保证金	4,371,547.16	-	-	-	4,371,547.16
交易性金融资产	416,016,000.00	-	57,242,542.50	6,152,983,964.85	6,626,242,507.35
买入返售金融资产	498,721,668.09	-	-	-	498,721,668.09
应收证券清算款	-	-	-	113,565,787.40	113,565,787.40
应收利息	-	-	-	5,584,149.12	5,584,149.12
应收股利	-	-	-	28,000.00	28,000.00
应收申购款	13,256.04	-	-	1,604,405.75	1,617,661.79
<b>资产总计</b>	<b>1,566,084,194.20</b>	<b>-</b>	<b>57,242,542.50</b>	<b>6,273,766,307.12</b>	<b>7,897,093,043.82</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	6,742,589.79	6,742,589.79
应付管理人报酬	-	-	-	9,975,920.96	9,975,920.96
应付托管费	-	-	-	1,662,653.48	1,662,653.48
应付交易费用	-	-	-	4,575,230.34	4,575,230.34
其他负债	-	-	-	242,514.83	242,514.83
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>23,198,909.40</b>	<b>23,198,909.40</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,566,084,194.20</b>	<b>-</b>	<b>57,242,542.50</b>	<b>6,250,567,397.72</b>	<b>7,873,894,134.42</b>
<b>上年末</b>					
<b>2012年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1至5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	441,475,775.06	-	-	-	441,475,775.06
结算备付金	3,236,512.74	-	-	-	3,236,512.74
存出保证金	-	-	-	3,140,539.81	3,140,539.81
交易性金融资产	249,460,000.00	7,649,184.00	-	6,991,685,354.94	7,248,794,538.94
应收证券清算款	-	-	-	14,687,591.17	14,687,591.17
应收利息	-	-	-	1,282,232.10	1,282,232.10

应收申购款	15,098.89	-	-	462,442.55	477,541.44
<b>资产总计</b>	<b>694,187,386.69</b>	<b>7,649,184.00</b>	-	<b>7,011,258,160.57</b>	<b>7,713,094,731.26</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	5,849,575.04	5,849,575.04
应付管理人报酬	-	-	-	9,158,215.10	9,158,215.10
应付托管费	-	-	-	1,526,369.17	1,526,369.17
应付交易费用	-	-	-	4,882,502.58	4,882,502.58
其他负债	-	-	-	1,697,686.63	1,697,686.63
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>23,114,348.52</b>	<b>23,114,348.52</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>694,187,386.69</b>	<b>7,649,184.00</b>	-	<b>6,988,143,812.05</b>	<b>7,689,980,382.74</b>

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：2013 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.01%(2012 年 12 月 31 日：3.34%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金组合投资的范围中股票占基金资产净值的 60%-95%；现金、债券、货币市场工具以及权证等其他金融工具占基金资产净值的 5%-40%。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 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	6,152,983,964.85	78.14	6,991,685,354.94	90.92
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,152,983,964.85	78.14	6,991,685,354.94	90.92

#### 7.4.13.4.3.2 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（2013 年 12 月 31 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	约 248,030,000.00	约 296,370,000.00
2. 沪深 300 指数下降 5%	约-248,030,000.00	约-296,370,000.00	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的

市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 5,783,659,990.95 元，属于第二层级的余额为 842,582,516.40 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 6,625,200,088.48 元，第二层级 623,594,450.46 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	6,152,983,964.85	77.91
	其中：股票	6,152,983,964.85	77.91
2	固定收益投资	473,258,542.50	5.99
	其中：债券	473,258,542.50	5.99
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	498,721,668.09	6.32
	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	646,961,722.91	8.19
6	其他各项资产	125,167,145.47	1.58
7	合计	7,897,093,043.82	100.00

## 8.2 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	-	-
C	制造业	3,909,540,557.12	49.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,148,841.07	1.54
E	建筑业	172,964,719.20	2.20
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	900,717,326.41	11.44
J	金融业	486,252,617.91	6.18
K	房地产业	8,256,874.50	0.10
L	租赁和商务服务业	19,116,413.74	0.24
M	科学研究和技术服务业	25,790,516.40	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	483,682,000.00	6.14
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	25,514,098.50	0.32
S	综合	-	-
	合计	6,152,983,964.85	78.14

## 8.3 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	002236	大华股份	14,700,000	583,236,000.00	7.41
2	300070	碧水源	11,800,000	483,682,000.00	6.14

3	002415	海康威视	21,000,000	482,580,000.00	6.13
4	601318	中国平安	9,825,628	410,023,456.44	5.21
5	600703	三安光电	11,000,000	272,690,000.00	3.46
6	000917	电广传媒	14,444,406	235,588,261.86	2.99
7	600406	国电南瑞	14,085,940	209,457,927.80	2.66
8	000977	浪潮信息	4,000,000	180,920,000.00	2.30
9	002241	歌尔声学	4,499,852	157,854,808.16	2.00
10	600887	伊利股份	4,000,000	156,320,000.00	1.99
11	300226	上海钢联	4,000,000	148,000,000.00	1.88
12	000895	双汇发展	3,136,922	147,686,287.76	1.88
13	601877	正泰电器	5,653,197	140,651,541.36	1.79
14	002008	大族激光	10,388,543	140,141,445.07	1.78
15	600686	金龙汽车	15,600,000	138,996,000.00	1.77
16	600690	青岛海尔	6,991,253	136,329,433.50	1.73
17	002051	中工国际	6,486,898	132,332,719.20	1.68
18	600436	片仔癀	1,330,869	125,514,255.39	1.59
19	603000	人民网	1,541,399	120,182,880.03	1.53
20	000333	美的集团	2,299,837	114,991,850.00	1.46
21	600594	益佰制药	3,299,990	107,645,673.80	1.37
22	300014	亿纬锂能	2,902,612	101,591,420.00	1.29
23	000049	德赛电池	1,439,441	101,048,758.20	1.28
24	600612	老凤祥	3,871,749	90,289,186.68	1.15
25	300005	探路者	4,830,655	76,807,414.50	0.98
26	002508	老板电器	1,945,276	76,799,496.48	0.98
27	600036	招商银行	6,999,923	76,229,161.47	0.97
28	600418	江淮汽车	8,000,000	69,840,000.00	0.89
29	002475	立讯精密	2,002,017	66,907,408.14	0.85
30	300145	南方泵业	1,748,870	65,844,955.50	0.84
31	002353	杰瑞股份	799,896	63,487,745.52	0.81
32	300295	三六五网	799,825	62,114,409.50	0.79
33	300288	朗玛信息	1,061,702	52,448,078.80	0.67
34	300346	南大光电	1,411,939	51,253,385.70	0.65
35	600323	瀚蓝环境	4,705,273	49,828,841.07	0.63
36	002557	洽洽食品	1,828,259	44,134,172.26	0.56
37	002253	川大智胜	1,532,173	41,429,957.92	0.53
38	002620	瑞和股份	2,400,000	40,632,000.00	0.52
39	002566	益盛药业	1,500,000	37,920,000.00	0.48
40	600079	人福医药	1,322,411	37,490,351.85	0.48
41	600021	上海电力	8,000,000	37,120,000.00	0.47

42	002470	金正大	1,682,187	35,830,583.10	0.46
43	600509	天富热电	4,000,000	34,200,000.00	0.43
44	002410	广联达	999,867	31,495,810.50	0.40
45	300202	聚龙股份	750,000	29,010,000.00	0.37
46	300012	华测检测	1,596,936	25,790,516.40	0.33
47	300133	华策影视	799,815	25,514,098.50	0.32
48	002340	格林美	2,000,000	20,500,000.00	0.26
49	000521	美菱电器	3,999,983	19,719,916.19	0.25
50	600138	中青旅	1,084,927	19,116,413.74	0.24
51	600894	广日股份	1,000,000	12,020,000.00	0.15
52	601238	广汽集团	1,200,000	9,888,000.00	0.13
53	600340	华夏幸福	408,150	8,256,874.50	0.10
54	300124	汇川技术	99,984	5,848,064.16	0.07
55	300206	理邦仪器	199,959	4,918,991.40	0.06
56	002224	三力士	249,860	2,833,412.40	0.04

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601166	兴业银行	1,017,655,501.16	13.23
2	600030	中信证券	677,246,683.44	8.81
3	600111	包钢稀土	560,255,899.09	7.29
4	600016	民生银行	436,639,619.85	5.68
5	002024	苏宁云商	396,029,100.24	5.15
6	601318	中国平安	351,856,645.70	4.58
7	600036	招商银行	347,176,272.64	4.51
8	000002	万科 A	308,211,121.27	4.01
9	600518	康美药业	267,367,263.62	3.48
10	601788	光大证券	262,337,240.81	3.41
11	601328	交通银行	260,712,447.65	3.39
12	000917	电广传媒	250,575,664.53	3.26
13	000049	德赛电池	248,062,200.18	3.23
14	002008	大族激光	242,946,406.29	3.16
15	002241	歌尔声学	240,500,472.57	3.13

16	600196	复星医药	224,202,917.41	2.92
17	600000	浦发银行	223,206,014.82	2.90
18	600703	三安光电	215,139,519.01	2.80
19	002236	大华股份	201,600,000.00	2.62
20	603000	人民网	193,636,447.61	2.52
21	601006	大秦铁路	186,002,873.03	2.42
22	600887	伊利股份	175,056,041.18	2.28
23	000977	浪潮信息	170,202,509.71	2.21
24	000100	TCL 集团	166,130,574.41	2.16
25	000970	中科三环	159,650,452.72	2.08
26	000527	美的电器	154,611,851.15	2.01

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。

#### 8.4.2 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	601166	兴业银行	987,101,684.21	12.84
2	600030	中信证券	655,501,063.29	8.52
3	600111	包钢稀土	578,773,894.29	7.53
4	600016	民生银行	421,894,012.48	5.49
5	600036	招商银行	394,532,929.48	5.13
6	002236	大华股份	364,268,902.94	4.74
7	600519	贵州茅台	357,984,861.43	4.66
8	002241	歌尔声学	334,430,202.68	4.35
9	000858	五粮液	332,057,025.00	4.32
10	002024	苏宁云商	319,209,911.63	4.15
11	000024	招商地产	311,880,282.53	4.06
12	601169	北京银行	284,973,053.75	3.71
13	002294	信立泰	272,728,133.75	3.55
14	000002	万科 A	262,637,305.04	3.42
15	601788	光大证券	252,107,621.63	3.28
16	600196	复星医药	246,932,098.14	3.21
17	601328	交通银行	242,888,150.63	3.16
18	600518	康美药业	232,858,581.54	3.03
19	600048	保利地产	218,652,646.19	2.84

20	600199	金种子酒	202,526,946.61	2.63
21	600000	浦发银行	201,617,350.95	2.62
22	600999	招商证券	182,568,344.46	2.37
23	002422	科伦药业	181,260,983.66	2.36
24	600383	金地集团	175,415,190.12	2.28
25	000049	德赛电池	173,146,785.79	2.25
26	601901	方正证券	171,024,628.81	2.22
27	600104	上汽集团	168,838,712.68	2.20
28	300070	碧水源	164,164,361.40	2.13
29	300315	掌趣科技	163,979,013.76	2.13
30	600015	华夏银行	163,320,293.65	2.12
31	600256	广汇能源	154,556,151.92	2.01

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。

#### 8.4.3 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	15,791,327,191.59
卖出股票收入（成交）总额	17,816,212,325.70

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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	416,016,000.00	5.28
	其中：政策性金融债	416,016,000.00	5.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	57,242,542.50	0.73
8	其他	-	-
9	合计	473,258,542.50	6.01

**8.6 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	090417	09 农发 17	1,700,000	167,076,000.00	2.12
2	130243	13 国开 43	1,500,000	148,950,000.00	1.89
3	130201	13 国开 01	1,000,000	99,990,000.00	1.27
4	113005	平安转债	533,730	57,242,542.50	0.73

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**8.8 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。

**8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.11 投资组合报告附注****8.11.1**

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。

**8.11.2**

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。

**8.11.3 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	4,371,547.16
2	应收证券清算款	113,565,787.40
3	应收股利	28,000.00
4	应收利息	5,584,149.12
5	应收申购款	1,617,661.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	125,167,145.47

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.11.5 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价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002236	大华股份	227,580,000.00	2.89	非公开发行

注：本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
261,861	23,334.01	317,168,521.72	5.19%	5,793,097,493.07	94.81%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,518,300.51	0.0248%

注：本公司基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额，本公司高级管理人员持有本基金份额的数量区间为 10 万份至 50 万份（含），本基金基金经理没有持有本基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年11月16日）基金份额总额	12,477,494,128.02
本报告期期初基金份额总额	6,838,438,121.92

本报告期基金总申购份额	351,238,096.27
减:本报告期基金总赎回份额	1,079,410,203.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,110,266,014.79

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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】13号文函复,基金管理人于2013年1月5日发布公告,自2013年1月1日起,高良玉不再担任公司总经理职务,由董事长吴万善代为履行公司总经理职务。

基金管理人于2013年7月27日发布公告,南方基金管理有限公司(以下简称“公司”)第五届董事会任期届满,根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定,公司股东会2013年第一次临时会议(以下简称“本次公司股东会临时会议”)选举产生了公司第六届董事会。公司第六届董事会由13名董事组成,其中由本次公司股东会临时会议选举产生12名(包括独立董事5名),经营管理层董事1名将由公司董事会聘任的公司总经理担任。公司本次股东会临时会议选举产生的公司第六届董事会12名董事为:吴万善先生、张涛先生、姜健先生、余钢先生、项建国先生、李自成先生、庄园芳女士、姚景源先生、李心丹先生、周锦涛先生、郑建彪先生、周蕊女士。

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。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 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

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 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，本报告期内支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 137,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

因基金管理人管理的南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（“开元 300ETF”）在集中申购期超过沪深 300 指数自然权重大比例接受停牌的永泰能源股票换购，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）的行政监管措施决定书，认为基金管理人在开元 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控制制度建设薄弱，缺乏 ETF 募集期股票换购的相关制度规定；合规及风控管理未能覆盖 ETF 基金投资环节；关于永泰能源的相关决策未能留痕等。鉴于上述情况，按照《证券投资基金管理公司管理办法》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 300ETF 超比例接受永泰能源股票换购给相关基金份额持有人造成的经济损失进行了补偿，实际补偿金额为 47,996,008.62 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并验收合格。

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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	

中信证券	24,341,953,355.07	13.02%	3,929,728.25	13.11%	-
华创证券	13,783,747,542.97	11.34%	3,348,239.82	11.17%	-
招商证券	22,785,145,491.67	8.35%	2,526,037.12	8.43%	-
中信建投	22,473,223,634.90	7.41%	2,220,367.14	7.41%	-
兴业证券	12,319,577,145.25	6.95%	2,052,597.00	6.85%	-
华西证券	12,156,869,552.82	6.47%	1,963,607.83	6.55%	-
中投证券	11,869,915,515.97	5.61%	1,654,689.03	5.52%	-
华泰证券	31,727,079,303.17	5.18%	1,531,881.46	5.11%	-
广发证券	11,469,586,133.60	4.41%	1,337,910.96	4.46%	-
海通证券	21,446,114,431.42	4.34%	1,316,546.15	4.39%	-
国泰君安	21,409,673,953.08	4.23%	1,247,423.20	4.16%	-
申银万国	11,290,048,989.41	3.87%	1,141,566.20	3.81%	-
中金公司	11,257,282,515.87	3.77%	1,144,626.90	3.82%	-
联讯证券	1 957,145,730.21	2.87%	871,378.30	2.91%	-
宏源证券	2 846,333,513.60	2.54%	770,504.51	2.57%	-
齐鲁证券	2 648,622,003.43	1.94%	590,504.20	1.97%	-
国信证券	2 571,137,425.65	1.71%	519,963.12	1.74%	-
红塔证券	1 557,740,774.05	1.67%	493,546.08	1.65%	-
东吴证券	1 467,712,855.84	1.40%	425,802.03	1.42%	-
瑞银证券	1 343,378,398.35	1.03%	312,609.30	1.04%	-
湘财证券	1 262,853,881.22	0.79%	232,600.04	0.78%	-
方正证券	1 221,691,873.87	0.66%	201,827.64	0.67%	-
大同证券	1 147,715,883.94	0.44%	130,714.52	0.44%	-
华宝经纪	1 -	-	-	-	-
南京证券	1 -	-	-	-	-
银河证券	1 -	-	-	-	-
华安证券	2 -	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、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。

### 11.7.2 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
中信证券	-	-	100,000,000.00	20.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	18,723,069.80	37.94%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	21,987,000.00	44.56%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	8,632,800.00	17.50%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	400,000,000.00	80.00%	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
华宝经纪	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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增加新兰德为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年12月31日
2	• 南方基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年12月31日
3	• 南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和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	2013年12月31日
4	• 南方基金关于旗下部分基金在中国工商银行开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年12月25日
5	• 南方基金关于旗下部分基金增加嘉实财富为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年12月20日
6	• 南方基金关于旗下部分基金增	中国证券报、上海证	2013年12月17日

	加万银财富为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	券报、证券时报	
7	• 南方基金关于旗下部分基金增加泛华普益为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 12 月 10 日
8	• 南方基金关于旗下部分基金增加金观诚为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 12 月 6 日
9	• 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	2013 年 12 月 6 日
10	• 南方基金关于调整部分开放式基金电子直销单笔赎回下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 10 月 31 日
11	• 南方基金关于旗下部分基金增加杭州联合农村商业银行作为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 10 月 29 日
12	• 南方基金关于旗下部分基金参加万银财富自助渠道基金申购及基金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	2013 年 9 月 30 日
13	• 南方基金关于旗下部分基金参加河北银行电子渠道基金申购及基金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	2013 年 8 月 30 日
14	• 南方基金关于旗下部分基金增	中国证券报、上海证	2013 年 8 月 8 日

	加中邮证券为代销机构及开通定投和转换业务的公告	券报、证券时报	
15	• 南方基金关于旗下部分基金参加深圳农村商业银行自助渠道基金申购及基金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	2013年8月1日
16	• 南方基金关于旗下部分基金增加开源证券为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年7月19日
17	• 南方基金关于旗下部分基金增加江南农村商业银行作为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年7月18日
18	• 南方基金关于旗下部分基金增加宜信普泽为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年7月17日
19	• 南方基金关于旗下部分基金增加万银财富为代销机构及开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年7月12日
20	• 南方基金关于旗下部分基金增加中期时代为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年7月10日
21	• 南方基金关于旗下部分基金增加同花顺为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年6月28日
22	• 南方基金关于旗下部分基金增加展恒为代销机构及开通转换业	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年6月21日

	务并参与其费率优惠活动的公告		
23	• 南方基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海证券推出基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 6 月 5 日
24	• 南方基金管理有限公司关于旗下基金获配大华股份（002236）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 5 月 31 日
25	• 南方基金关于旗下部分基金增加珠海华润银行为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 5 月 22 日
26	• 南方基金关于旗下部分基金参加重庆银行网银申购及网银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	2013 年 5 月 22 日
27	• 南方基金关于旗下部分基金参加徽商银行网上银行申购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	2013 年 5 月 10 日
28	• 南方基金管理有限公司关于旗下基金在上海好买基金销售有限公司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	2013 年 4 月 26 日
29	• 南方基金关于旗下部分基金参加大连银行个人网上银行申购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	2013 年 4 月 2 日
30	• 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	2013 年 4 月 1 日
31	• 南方基金管理有限公司关于旗下基金获配天富热电（600509）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 3 月 25 日

32	<ul style="list-style-type: none"> <li>南方基金关于旗下部分基金增加东兴证券为代销机构及开通转换业务的公告</li> </ul>	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 3 月 1 日
33	<ul style="list-style-type: none"> <li>南方基金关于旗下部分基金增加联讯证券为代销机构及开通定投和转换业务的公告</li> </ul>	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 2 月 28 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方绩优成长股票型证券投资基金的文件。
- 2、南方绩优成长股票型证券投资基金基金合同。
- 3、南方绩优成长股票型证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 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

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>