

南方优选成长混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 25 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 01 月 01 日起至 12 月 31 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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
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
§4 管理人报告	9
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.....	10
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.....	11
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	39
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
8.11 投资组合报告附注	45
§9 基金份额持有人信息.....	46
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
§10 开放式基金份额变动.....	46
§11 重大事件揭示.....	46
11.1 基金份额持有人大会决议	46
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	47
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
11.4 基金投资策略的改变	47
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
11.8 其他重大事件	50
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方优选成长混合型证券投资基金
基金简称	南方优选成长混合
基金主代码	202023
前端交易代码	202023
后端交易代码	202024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 30 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1, 153, 981, 203. 47 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“南方成长”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选高成长性的优质企业进行重点投资，并通过动态的资产配置，增加组合的超额收益，在有效控制市场风险的前提下，力争为投资者寻求长期稳定的资产增值。
投资策略	<p>本基金基于宏观经济环境、微观经济因素、经济周期情况、政策形势和证券市场趋势的综合分析，结合经济周期投资时钟理论，形成对不同市场周期的预测和判断，进行积极、灵活的资产配置，确定组合中股票、债券、现金等资产之间的投资比例。</p> <p>本基金为混合型基金，通过积极分析判断市场趋势，运用战略资产配置策略和风险管理策略，系统化管理各大类资产的配置比例。本基金严谨衡量不同类别资产的预期风险/收益特征，评估股票市场价值，如股票市场价值的整体估值水平偏离企业实际的盈利状况和预期的成长率或预计将出现较大的偏离，本基金将及时降低股票资产配置，或适度增加债券市场的配置权重，避免或减少可能给投资人带来潜在的资本损失。</p>
业绩比较基准	本基金为混合型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用了上证国债指数。因此，本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式： $60\% \times \text{沪深 300 指数} + 40\% \times \text{上证国债指数}$ 。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和收益水平高于债

	券基金及货币市场基金，低于股票基金。
--	--------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
注册地址		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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		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	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		吴万善	王洪章

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	http://www.nffund.com
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六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

§ 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 1 月 30 日(基金合同生效)
---------------	--------	--------	-------------------------

			日)-2011年12月31日
本期已实现收益	120,849,729.64	-151,048,341.13	-125,260,976.95
本期利润	166,524,839.48	130,006,707.34	-317,266,138.26
加权平均基金份额本期利润	0.1412	0.0828	-0.1630
本期加权平均净值利润率	14.43%	9.65%	-17.31%
本期基金份额净值增长率	13.68%	9.99%	-16.90%
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	-63,535,582.89	-224,353,038.75	-297,295,462.49
期末可供分配基金份额利润	-0.0551	-0.1580	-0.1691
期末基金资产净值	1,198,907,502.59	1,297,258,511.66	1,461,226,790.92
期末基金份额净值	1.039	0.914	0.831
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	3.90%	-8.60%	-16.90%

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

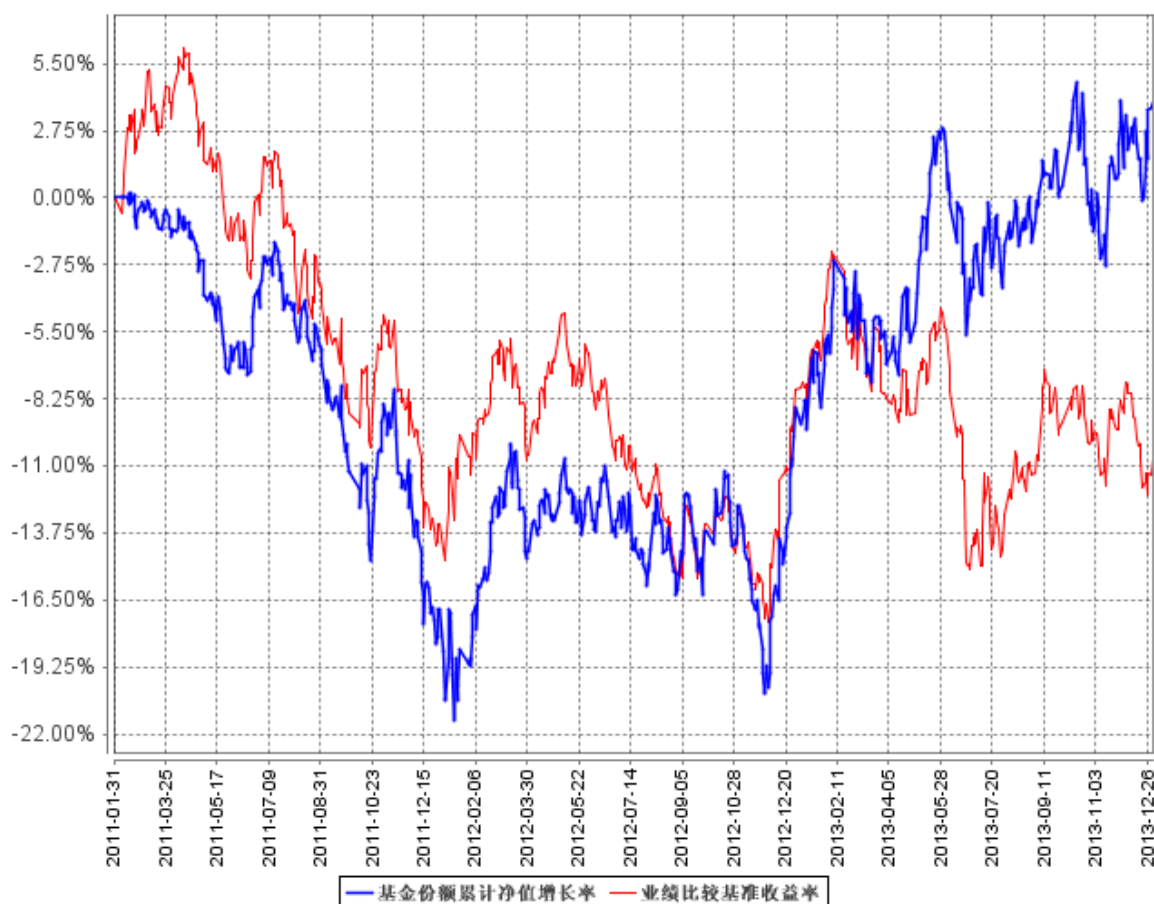
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.38%	1.04%	-1.65%	0.67%	5.03%	0.37%
过去六个月	7.89%	0.91%	4.17%	0.77%	3.72%	0.14%
过去一年	13.68%	0.94%	-3.08%	0.84%	16.76%	0.10%
自基金合同生效起至今	3.90%	0.86%	-10.70%	0.79%	14.60%	0.07%

注：本基金的业绩比较基准为 60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

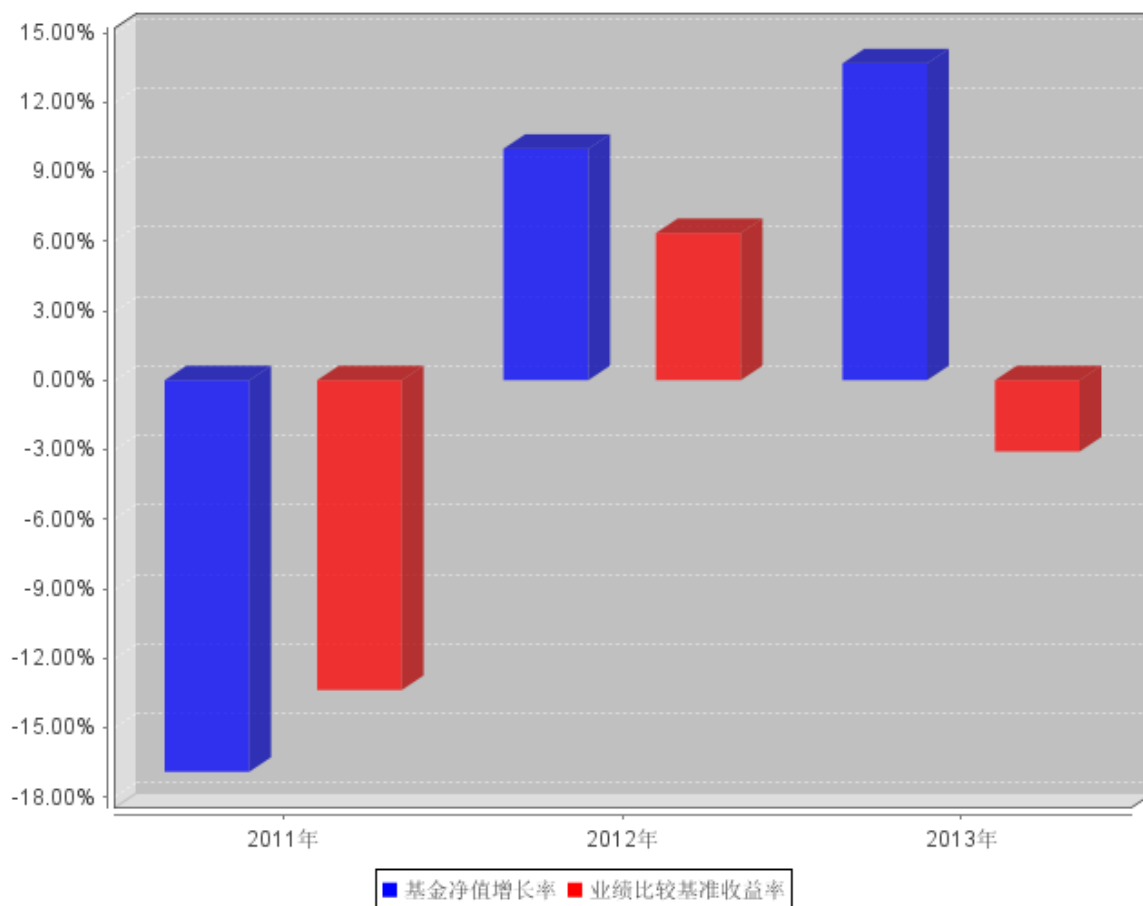
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同中关于基金投资比例的约定：股票资产占基金资产的 30%~80%；债券、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 20%—70%。本基金的建仓期为 2011 年 1 月 30 日至 2011 年 7 月 29 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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



注：2011 年按基金合同生效当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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		
谈建强	本基金基金经理	2011 年 1 月 30 日	-	17	经济学硕士，注册会计师，具有基金从业资格。曾任职于上海中华实业股份有限公司、海南港澳国际信托投资公司、中海信托投资有限责任公司。2006 年 9 月加入南方基金，2006 年 12 月至 2008 年 6 月，任南方绩优基金经理；2008 年 4 月至 2013 年 4 月，任南方高增基金经理；2008 年 6 月至今，任南方价值基金经理；2011 年 1 月至今，任南方成长基金经理。

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，“离任日期”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、《南方优选成长混合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。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，均是由于指数型基金根据标的指数成份股调整而被动调仓所致。

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

2013年，A股市场呈现明显的结构分化行情，在经济增速放缓，资金利率持续走高的背景下，金融地产和与投资相关的周期性行业股票表现低迷，与此相反，代表经济转型方向的成长股行情精彩纷呈，创业板指数全年上涨达82%，而沪深300指数却下跌近8%。基于对宏观经济趋势和风险控制的考虑，2013年本基金在2月份市场高点减仓后基本持防御策略，因而错失了不少成长股的投资机会，对全年的基金业绩表现造成较大的影响。四季度开始，本基金管理人适当修正了投资思路，增加了对互联网、消费电子和生态环保等新兴产业的投资力度，基金投资业绩获得明显改善。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.039元，本报告期份额净值增长率为13.68%，同期业绩比较基准增长率为-3.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年，中国经济仍处于转型关键阶段，在房价、通胀、环保三大约束下，经济增长提速的可能性不大，宏观经济对 A 股市场的影响将继续弱化。而依然旺盛的资金需求、美国 QE 逐步退出和利率市场化进程加速将导致市场资金面偏紧，资金利率将持续高企，这将对 A 股市场构成压力。另一方面，十八届三中全会带来的改革乐观预期提升了市场对中国经济转型成功的信心，符合转型方向的成长股板块仍将不断演绎出新的投资主题。本基金管理人认为 2014 年 A 股市场仍将维持震荡筑底行情，以成长股为代表的结构性行情将继续给市场提供良好的投资机会。本基金管理人将加强研究，运用多种风险控制手段，寻找结构性和阶段性投资机会，力争为基金持有人创造良好的投资收益。

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、数量化投资部总监、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：本基金的每份基金份额享有同等分配权；、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择

现金红利或将现金红利按除权后的单位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；基金收益分配后每一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；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有收益分配事项。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 21227 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	南方优选成长混合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优选成长混合型证券投资基金(以下简称“南方优选成长混合基金”)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	<p>编制和公允列报财务报表是南方优选成长混合基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>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>
审计意见段	我们认为，上述 南方优选成长混合基金 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，公允反映了南方优选成长混合基金 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。
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：南方优选成长混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	112,080,520.39	45,284,776.87
结算备付金		15,354,813.53	17,765,863.38
存出保证金		5,146,244.72	42,471.91
交易性金融资产	7.4.7.2	1,096,427,230.60	1,223,847,342.26
其中：股票投资		830,433,026.70	961,404,662.26
基金投资		-	-
债券投资		265,994,203.90	262,442,680.00
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	-	-
应收证券清算款		-	12,548,242.20
应收利息	7.4.7.5	1,163,088.91	3,355,217.09
应收股利		-	-
应收申购款		133,063.31	116,631.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,230,304,961.46	1,302,960,545.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		23,760,212.64	995,806.73
应付赎回款		5,247,802.89	1,691,853.69
应付管理人报酬		1,521,788.93	1,548,328.30
应付托管费		253,631.51	258,054.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	413,688.31	810,988.28
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	200,334.59	397,001.75
负债合计		31,397,458.87	5,702,033.47
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,153,981,203.47	1,419,781,560.37
未分配利润	7.4.7.10	44,926,299.12	-122,523,048.71
所有者权益合计		1,198,907,502.59	1,297,258,511.66
负债和所有者权益总计		1,230,304,961.46	1,302,960,545.13

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.039 元，基金份额总额 1,153,981,203.47 份。

7.2 利润表

会计主体：南方优选成长混合型证券投资基金

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
一、收入		191,038,607.15	158,044,690.25
1. 利息收入		8,416,566.38	12,428,545.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,275,476.21	1,210,777.88
债券利息收入		6,692,811.84	11,125,941.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		448,278.33	91,826.10
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		136,719,291.18	-135,724,659.81
其中：股票投资收益	7.4.7.12	112,584,524.94	-146,708,846.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,797,127.25	2,651,783.17
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	7,299,300.00	1,396,080.00
股利收益	7.4.7.15	11,038,338.99	6,936,323.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	45,675,109.84	281,055,048.47
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	227,639.75	285,756.38
减：二、费用		24,513,767.67	28,037,982.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	17,337,698.36	20,260,990.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,889,616.36	3,376,831.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	3,836,322.66	3,989,901.98
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	450,130.29	410,258.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		166,524,839.48	130,006,707.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		166,524,839.48	130,006,707.34

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方优选成长混合型证券投资基金

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）	1,419,781,560.37	-122,523,048.71	1,297,258,511.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	166,524,839.48	166,524,839.48
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）	-265,800,356.90	924,508.35	-264,875,848.55
其中：1. 基金申购款	529,610,619.12	-7,444,172.19	522,166,446.93
2. 基金赎回款	-795,410,976.02	8,368,680.54	-787,042,295.48
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）	1,153,981,203.47	44,926,299.12	1,198,907,502.59
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）	1,758,522,253.41	-297,295,462.49	1,461,226,790.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	130,006,707.34	130,006,707.34
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）	-338,740,693.04	44,765,706.44	-293,974,986.60
其中：1. 基金申购款	30,681,990.33	-4,354,983.48	26,327,006.85
2. 基金赎回款	-369,422,683.37	49,120,689.92	-320,301,993.45
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）	1,419,781,560.37	-122,523,048.71	1,297,258,511.66

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

南方优选成长混合型证券投资基金(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”)证监许可[2010]第 1754 号《关于核准南方优选成长混合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《南方优选成长混合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 2,216,633,494.07 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 046 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方优选成长混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,216,873,965.77 份。其中认购资金利息折合 240,471.70 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方优选成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市各类股票、债券、短期金融工具、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投

投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%-80%，其中投资于高成长性企业的资产不低于股票资产的 80%；债券、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 20%-70%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深 300 指数+40%×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》、《南方优选成长混合型证券投资基金 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

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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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 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, 其处置价格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：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，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》之附件《非公开发行有

明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，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。

(3) 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，应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	112,080,520.39	45,284,776.87
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	112,080,520.39	45,284,776.87

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	690,878,223.22	830,433,026.70	139,554,803.48	
债券	交易所市场	270,860,070.38	265,994,203.90	-4,865,866.48
	银行间市场	-	-	-
	合计	270,860,070.38	265,994,203.90	-4,865,866.48
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	961,738,293.60	1,096,427,230.60	134,688,937.00	
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	874,752,477.40	961,404,662.26	86,652,184.86	
债券	交易所市场	150,199,063.73	152,314,680.00	2,115,616.27
	银行间市场	109,845,913.97	110,128,000.00	282,086.03
	合计	260,044,977.70	262,442,680.00	2,397,702.30
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,134,797,455.10	1,223,847,342.26	89,049,887.16	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-35,262,060.00	-	-	
股指期货	-35,262,060.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-35,262,060.00	-	-	
项目	上年度末 2012年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

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	19,552.76	14,416.05
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	3,931.66	4,214.03
应收债券利息	1,139,498.23	3,336,587.01
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	106.26	-
合计	1,163,088.91	3,355,217.09

7.4.7.6 其他资产

注：无。

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	413,688.31	810,588.28
银行间市场应付交易费用	-	400.00
合计	413,688.31	810,988.28

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	-	-
应付赎回费	8,334.59	5,001.75
预提费用	192,000.00	392,000.00
合计	200,334.59	397,001.75

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	1,419,781,560.37	1,419,781,560.37
本期申购	529,610,619.12	529,610,619.12
本期赎回（以“-”号填列）	-795,410,976.02	-795,410,976.02
本期末	1,153,981,203.47	1,153,981,203.47

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	-224,353,038.75	101,829,990.04	-122,523,048.71
本期利润	120,849,729.64	45,675,109.84	166,524,839.48
本期基金份额交易	39,967,726.22	-39,043,217.87	924,508.35

产生的变动数			
其中：基金申购款	-28,473,849.90	21,029,677.71	-7,444,172.19
基金赎回款	68,441,576.12	-60,072,895.58	8,368,680.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-63,535,582.89	108,461,882.01	44,926,299.12

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	1,125,053.09	1,137,069.06
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	137,544.49	72,383.08
其他	12,878.63	1,325.74
合计	1,275,476.21	1,210,777.88

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	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
卖出股票成交总额	1,353,210,603.02	1,394,022,501.92
减：卖出股票成本总额	1,240,626,078.08	1,540,731,348.88
买卖股票差价收入	112,584,524.94	-146,708,846.96

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	301,553,013.07	303,488,987.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	288,505,207.63	292,252,194.30
减：应收利息总额	7,250,678.19	8,585,010.15
债券投资收益	5,797,127.25	2,651,783.17

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	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
股指期货投资收益	7,299,300.00	1,396,080.00
合计	7,299,300.00	1,396,080.00

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	11,038,338.99	6,936,323.98
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,038,338.99	6,936,323.98

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	45,639,049.84	281,055,048.47
——股票投资	52,902,618.62	279,804,446.88
——债券投资	-7,263,568.78	1,250,601.59
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	36,060.00	-
——权证投资	-	-
——股指期货	36,060.00	-
3. 其他	-	-
合计	45,675,109.84	281,055,048.47

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	157,044.77	281,904.33
转换费	38,399.22	3,852.05

其他	32,195.76	-
合计	227,639.75	285,756.38

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 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	3,836,322.66	3,988,651.98
银行间市场交易费用	-	1,250.00
合计	3,836,322.66	3,989,901.98

7.4.7.19 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	92,000.00	92,000.00
信息披露费	300,000.00	270,000.00
债券帐户维护费	36,000.00	33,000.00
银行划款手续费	21,730.29	14,858.83
其他	400	400.00
合计	450,130.29	410,258.83

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设”）	基金托管人、基金销售机构

银行”)	
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
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	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：关联方与基金进行的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
兴业证券	498,501,682.87	20.71%	544,433,336.71	21.34%
华泰证券	94,259,678.30	3.92%	13,373,600.56	0.52%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
兴业证券	441,124.67	20.46%	137,192.49	33.16%
华泰证券	85,793.42	3.98%	-	-
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
兴业证券	465,672.52	21.32%	216,432.48	26.70%
华泰证券	12,175.38	0.56%	-	-

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	17,337,698.36	20,260,990.48
其中：支付销售机构的客户维护费	5,234,090.96	6,469,438.76

注：支付基金管理人 南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 1.50% / 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	2,889,616.36	3,376,831.62

注：支付基金托管人 中国建设银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 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	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
中国建设银行	112,080,520.39	1,125,053.09	45,284,776.87	1,137,069.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

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混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理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 中国建设银行，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 22.19%（2012 年 12 月 31 日：14.07%）。

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%。本基金所持证券在证券交易所上市，均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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

本期末 2013 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	112,080,520.39	-	-	-	112,080,520.39
结算备付金	15,354,813.53	-	-	-	15,354,813.53
存出保证金	5,146,244.72	-	-	-	5,146,244.72
交易性金融资产	78,736,000.00	85,357,339.00	101,900,864.90	830,433,026.70	1,096,427,230.60
应收利息	-	-	-	1,163,088.91	1,163,088.91
应收申购款	5,459.74	-	-	127,603.57	133,063.31
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	211,323,038.38	85,357,339.00	101,900,864.90	831,723,719.18	1,230,304,961.46
负债					
应付证券清算款	-	-	-	23,760,212.64	23,760,212.64
应付赎回款	-	-	-	5,247,802.89	5,247,802.89
应付管理人报酬	-	-	-	1,521,788.93	1,521,788.93
应付托管费	-	-	-	253,631.51	253,631.51
应付交易费用	-	-	-	413,688.31	413,688.31
其他负债	-	-	-	200,334.59	200,334.59
负债总计	-	-	-	31,397,458.87	31,397,458.87
利率敏感度缺口	211,323,038.38	85,357,339.00	101,900,864.90	800,326,260.31	1,198,907,502.59
上年度末 2012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	45,284,776.87	-	-	-	45,284,776.87
结算备付金	17,765,863.38	-	-	-	17,765,863.38
存出保证金	-	-	-	42,471.91	42,471.91
交易性金融资产	120,776,760.00	114,163,120.00	27,502,800.00	961,404,662.26	1,223,847,342.26
应收证券清算款	-	-	-	12,548,242.20	12,548,242.20
应收利息	-	-	-	3,355,217.09	3,355,217.09
应收申购款	6,074.78	-	-	110,556.64	116,631.42
资产总计	183,833,475.03	114,163,120.00	27,502,800.00	977,461,150.10	1,302,960,545.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	995,806.73	995,806.73
应付赎回款	-	-	-	1,691,853.69	1,691,853.69
应付管理人报酬	-	-	-	1,548,328.30	1,548,328.30
应付托管费	-	-	-	258,054.72	258,054.72
应付交易费用	-	-	-	810,988.28	810,988.28
其他负债	-	-	-	397,001.75	397,001.75
负债总计	-	-	-	5,702,033.47	5,702,033.47
利率敏感度缺口	183,833,475.03	114,163,120.00	27,502,800.00	971,759,116.63	1,297,258,511.66

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

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：人民币万元）	
		本期末（2013年12月31日）	上年度末（2012年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	增加约 39	增加约 78
市场利率上升 25 个基点	下降约 38	下降约 77	

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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%-80%，其中投资于高成长性企业的资产不低于股票资产的 80%；债券、权证、货币市场工具、资产支持证券及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 20%-70%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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	830,433,026.70	69.27	961,404,662.26	74.11
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	830,433,026.70	69.27	961,404,662.26	74.11

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%	增加约 3,956	增加约 4,086
2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 3,956	下降约 4,086	

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 1,096,427,230.60 元, 无属于第二层级及第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日: 第一层级 1,038,090,106.90 元, 第二层级 185,757,235.36 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	830,433,026.70	67.50
	其中: 股票	830,433,026.70	67.50
2	固定收益投资	265,994,203.90	21.62
	其中: 债券	265,994,203.90	21.62
	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	127,435,333.92	10.36
6	其他各项资产	6,442,396.94	0.52
7	合计	1,230,304,961.46	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	28,783,423.04	2.40
C	制造业	524,664,557.18	43.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,560,000.00	1.05
F	批发和零售业	13,961,519.67	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	25,865,000.00	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	121,181,076.15	10.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	57,122,372.16	4.76
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	37,184,078.50	3.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,111,000.00	0.76
S	综合	-	-
	合计	830,433,026.70	69.27

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	000581	威孚高科	2,205,479	67,928,753.20	5.67
2	002285	世联地产	3,624,516	57,122,372.16	4.76
3	300070	碧水源	907,150	37,184,078.50	3.10
4	600703	三安光电	1,399,552	34,694,894.08	2.89
5	002565	上海绿新	1,715,835	34,419,650.10	2.87
6	600406	国电南瑞	2,184,500	32,483,515.00	2.71
7	300124	汇川技术	527,317	30,842,771.33	2.57
8	002008	大族激光	2,199,842	29,675,868.58	2.48
9	600583	海油工程	3,709,204	28,783,423.04	2.40

10	002104	恒宝股份	1,799,854	27,285,786.64	2.28
11	000651	格力电器	805,853	26,319,158.98	2.20
12	601006	大秦铁路	3,500,000	25,865,000.00	2.16
13	002230	科大讯飞	520,000	24,882,000.00	2.08
14	002152	广电运通	1,199,904	23,026,157.76	1.92
15	002415	海康威视	1,000,000	22,980,000.00	1.92
16	600309	烟台万华	1,100,857	22,787,739.90	1.90
17	600446	金证股份	1,371,076	21,183,124.20	1.77
18	002475	立讯精密	603,465	20,167,800.30	1.68
19	000800	一汽轿车	1,599,993	19,039,916.70	1.59
20	002294	信立泰	550,000	18,920,000.00	1.58
21	002241	歌尔声学	475,994	16,697,869.52	1.39
22	300226	上海钢联	449,853	16,644,561.00	1.39
23	300113	顺网科技	311,825	15,987,267.75	1.33
24	002100	天康生物	1,199,918	15,298,954.50	1.28
25	600827	友谊股份	1,414,541	13,961,519.67	1.16
26	601668	中国建筑	4,000,000	12,560,000.00	1.05
27	002236	大华股份	300,000	12,264,000.00	1.02
28	000400	许继电气	389,939	12,123,203.51	1.01
29	300021	大禹节水	999,952	11,519,447.04	0.96
30	600151	航天机电	1,199,902	10,271,161.12	0.86
31	002009	天奇股份	799,927	10,039,083.85	0.84
32	000503	海虹控股	478,498	10,000,608.20	0.83
33	300054	鼎龙股份	504,224	9,933,212.80	0.83
34	002456	欧菲光	200,000	9,616,000.00	0.80
35	002557	洽洽食品	396,200	9,564,268.00	0.80
36	300303	聚飞光电	465,897	9,322,598.97	0.78
37	600633	*ST 白猫	300,000	9,111,000.00	0.76
38	300155	安居宝	414,470	8,235,518.90	0.69
39	002376	新北洋	499,945	5,499,395.00	0.46
40	300217	东方电热	287,440	5,418,244.00	0.45
41	300198	纳川股份	52,592	773,102.40	0.06

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	600519	贵州茅台	68,205,583.63	5.26
2	002285	世联地产	45,743,524.05	3.53
3	601006	大秦铁路	38,933,079.34	3.00
4	000581	威孚高科	37,538,484.54	2.89
5	002008	大族激光	33,273,431.60	2.56
6	600583	海油工程	29,125,945.37	2.25
7	600703	三安光电	29,040,384.69	2.24
8	002230	科大讯飞	29,017,237.54	2.24
9	002415	海康威视	28,466,817.51	2.19
10	002565	上海绿新	28,006,185.01	2.16
11	002104	恒宝股份	27,512,695.05	2.12
12	600184	光电股份	26,708,571.37	2.06
13	000800	一汽轿车	23,963,697.22	1.85
14	600000	浦发银行	21,317,766.32	1.64
15	600446	金证股份	21,236,323.14	1.64
16	600036	招商银行	20,985,675.07	1.62
17	300113	顺网科技	20,370,705.50	1.57
18	000776	广发证券	20,319,863.87	1.57
19	600837	海通证券	18,967,280.61	1.46
20	601166	兴业银行	18,775,690.19	1.45

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	002230	科大讯飞	88,188,690.62	6.80
2	600519	贵州茅台	59,501,844.05	4.59
3	000568	泸州老窖	55,130,378.71	4.25
4	600030	中信证券	52,206,172.37	4.02
5	002241	歌尔声学	42,906,313.24	3.31
6	002294	信立泰	41,757,252.98	3.22
7	300070	碧水源	38,745,833.19	2.99
8	600104	上海汽车	34,173,164.28	2.63

9	000024	招商地产	32,902,594.60	2.54
10	002255	海陆重工	32,539,383.50	2.51
11	600837	海通证券	31,048,319.88	2.39
12	601788	光大证券	30,663,399.06	2.36
13	000002	万科A	30,280,779.61	2.33
14	000826	桑德环境	29,320,739.29	2.26
15	601318	中国平安	23,860,386.34	1.84
16	600276	恒瑞医药	23,458,040.92	1.81
17	600184	光电股份	22,065,743.70	1.70
18	000069	华侨城A	20,106,341.80	1.55
19	600036	招商银行	19,731,517.15	1.52
20	600298	安琪酵母	19,725,409.08	1.52

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	1,056,751,823.90
卖出股票收入（成交）总额	1,353,210,603.02

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	98,052,439.00	8.18
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	167,941,764.90	14.01
8	其他	-	-
9	合计	265,994,203.90	22.19

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	110023	民生转债	572,050	55,219,986.50	4.61
2	110015	石化转债	440,000	41,958,400.00	3.50
3	126011	08 石化债	400,000	39,764,000.00	3.32
4	126016	08 宝钢债	400,000	38,972,000.00	3.25
5	110024	隧道转债	258,090	25,230,878.40	2.10

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

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

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**8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1401	IF1401	-50	-35,226,000.00	36,060.00	-
公允价值变动总额合计（元）					36,060.00
股指期货投资本期收益（元）					7,299,300.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					36,060.00

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则—金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具—股指期货投资”与“证券清算款—股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具—股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降

低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人建立了股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

本基金本报告期内的股指期货交易符合既定投资政策和投资目标。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	5,146,244.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,163,088.91
5	应收申购款	133,063.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,442,396.94

8.11.4 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	110023	民生转债	55,219,986.50	4.61
2	110015	石化转债	41,958,400.00	3.50
3	113001	中行转债	24,082,500.00	2.01

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中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
19,618	58,822.57	446,125,385.70	38.66%	707,855,817.77	61.34%

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	1,287,347.56	0.1116%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额，本基金基金经理持有本基金份额，数量区间为 50 万份至 100 万份（含）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 1 月 30 日）基金份额总额	2,216,873,965.77
本报告期期初基金份额总额	1,419,781,560.37
本报告期基金总申购份额	529,610,619.12
减：本报告期基金总赎回份额	795,410,976.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,153,981,203.47

§ 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。

本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 92,000 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 3 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,2013 年 8 月已完成整改工作、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	
兴业证券	1	498,501,682.87	20.71%	441,124.67	20.46%	-
银河证券	1	440,235,347.99	18.29%	400,670.47	18.58%	-
国金证券	1	350,462,606.67	14.56%	318,926.16	14.79%	-
宏源证券	1	278,172,245.37	11.55%	246,154.41	11.42%	-
天源证券	1	189,630,168.06	7.88%	167,803.68	7.78%	-
招商证券	1	162,632,577.20	6.76%	143,914.01	6.67%	-
国泰君安	1	139,775,322.90	5.81%	123,687.56	5.74%	-
中金公司	1	112,468,858.36	4.67%	99,524.02	4.62%	-
华泰证券	1	94,259,678.30	3.92%	85,793.42	3.98%	-
银泰证券	1	78,095,923.29	3.24%	71,077.98	3.30%	-
齐鲁证券	1	63,303,325.91	2.63%	57,483.86	2.67%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

安信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	119,170,025.19	27.08%	-	-	-	-
国金证券	133,601,366.35	30.36%	100,000,000.00	25.64%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	20,053,345.50	4.56%	-	-	-	-
银泰证券	20,599,670.80	4.68%	290,000,000.00	74.36%	-	-
齐鲁证券	146,564,915.22	33.31%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-

注：1. 本基金本报告期内终止交易单元为中邮证券，其他交易单元未发生变化。

2. 交易单元的选择标准和程序

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

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、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;

3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

4、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席位:

1、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;

2、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;

3、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。

11.8 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
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
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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 12 月 17 日
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	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
10	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
11	南方优选成长混合 2013 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 10 月 24 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	南方优选成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2013 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 9 月 3 日
14	南方优选成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2013 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 9 月 3 日

15	南方基金关于旗下部分基金增加深圳农村商业银行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 9 月 2 日
16	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
17	南方基金关于旗下部分基金增加重庆农商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 8 月 30 日
18	南方优选成长混合型证券投资基金 2013 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 8 月 27 日
19	南方优选成长混合型证券投资基金 2013 年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 8 月 27 日
20	南方基金关于旗下部分基金增加中邮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 8 月 8 日
21	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
22	南方优选成长混合型证券投资基金 2013 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 7 月 19 日
23	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
24	南方基金关于旗下部分基金增加江南农村商业银行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

25	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
26	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
27	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
28	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
29	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 21 日
30	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
31	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
32	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
33	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

34	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
35	南方优选成长混合 2013 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 4 月 19 日
36	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
37	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
38	南方优选成长混合型证券投资基金 2012 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 3 月 29 日
39	南方优选成长混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2013 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 3 月 6 日
40	南方优选成长混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2013 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 3 月 6 日
41	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 3 月 1 日
42	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 2 月 28 日
43	南方优选成长混合 2012 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 1 月 21 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优选成长混合型证券投资基金的文件
- 2、南方优选成长混合型证券投资基金基金合同
- 3、南方优选成长混合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>