

# 南方绩优成长股票型证券投资基金 2014 年 半年度报告摘要

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	5,622,686,728.41 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	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。 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。
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
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
		赵会军
		010-66105799
		custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	777,770,497.73
本期利润	-370,849,376.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0636
本期基金份额净值增长率	-5.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0092
期末基金资产净值	6,770,285,680.57
期末基金份额净值	1.2041

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

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

### 3.2 基金净值表现

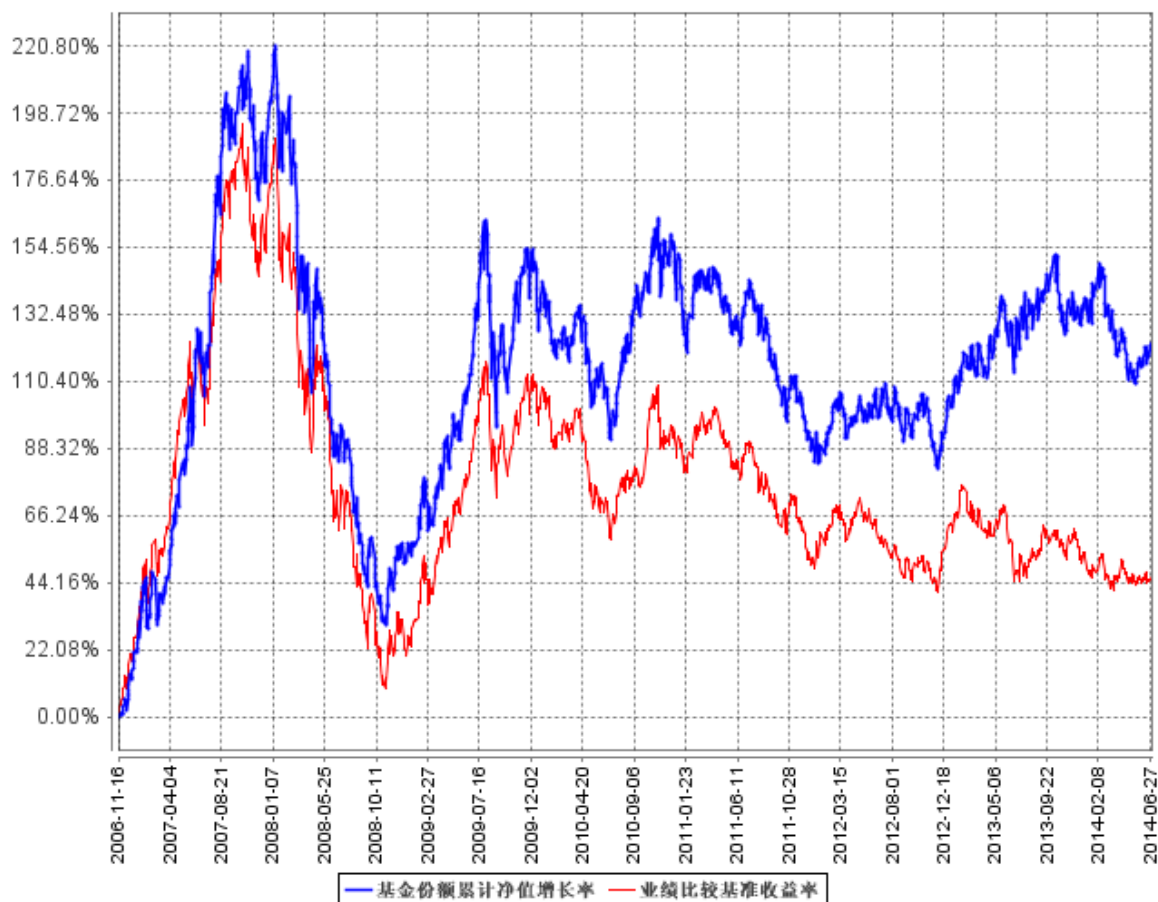
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.98%	0.68%	0.40%	0.62%	2.58%	0.06%
过去三个月	2.13%	0.74%	0.95%	0.70%	1.18%	0.04%

过去六个月	-5.02%	1.01%	-5.27%	0.83%	0.25%	0.18%
过去一年	2.20%	1.15%	-0.47%	0.94%	2.67%	0.21%
过去三年	-4.75%	1.13%	-21.56%	1.04%	16.81%	0.09%
自基金合同生效起至今	123.56%	1.57%	46.17%	1.53%	77.39%	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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理

公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本 1.5 亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模近 2,800 亿元，旗下管理 51 只开放式基金，1 只封闭式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		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	-	8	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、公司总裁助理兼权益投资总监	2011年2月17日	-	16	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，现任南方基金总裁助理兼权益投资总监、境内权益投资决策委员会主席、年金投资决策委员会主席、国际投资决策委员会委员。2011年2月至今，任南方绩优基金经理；2014年2月至今，任南方新优享基金经理。
熊琳	本基金的基金	2012年3月15日	-	8	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

	经理助理			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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 4 次，其中 1 次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致，3 次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，我国经济增速放缓，通胀走低，政府出台一系列微刺激措施稳定经济增长，使得经济出现低位企稳的迹象。今年 1-4 月，公布的主要国内宏观实体数据低于预期，市场对全年

经济的预期持续向下修正，过程中中央、国务院逐步出台了微刺激政策、定向调控来保增长，二季度末起，以 PMI 为主要指标的宏观数据回暖。

在此背景下大盘指数低位震荡。上半年，市场主要为存量博弈，大盘和中小盘、成长类呈现蹊跷效应。2 月份受暂停 IPO 影响，市场整体展开反弹，随后再度回落。到了二季度后期，一些经济先行指标呈现出改善迹象，市场虽然看到了改革的动作和趋势，但更多的是停留在对老经济“破”带来影响的关注上。受此影响，上半年整体表现较好的仍为中小盘、创业板及成长类股票，沪指、深成指分别下跌 3.20%、9.59%，创业板指上涨 7.69%。从时序来看，一季度前期市场风格明显偏向中小盘成长风格，之后随着以创业板等代表中小盘成长风格的指数的大幅回调，市场风格开始偏向大盘-价值风格。从 5 月中下旬起，创业板指数小幅反弹，市场风格再度偏向小盘-成长风格。从行业表现上看，上半年，计算机、通信、餐饮旅游等表现较好；煤炭、非银行金融、农林牧渔等行业表现相对靠后。

具体操作上，绩优成长基金在仓位和持仓结构上进行了较大的调整，对经营模式发生变化、整体市值偏高、估值中枢可能从成长股转化为价值股的相关品种进行了减仓，并适当加大了结构优化，更加加强自下而上的个股和细分行业价值发掘的力度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年上半年，南方绩优成长基金净值增长-5.02%，同期业绩比较基准增长-5.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年是中国经济新旧模式转型的规划后期和实施期，经济增速换挡期、结构调整阵痛期、前期刺激消化期三期叠加，“稳增长”政策将托经济增长的底，“促转型”的举措将蕴含新常态的机遇。在此阶段，虽然市场对中国经济增速换挡的方式仍有分歧和担忧，且惯性忽略改革初期的众多向好迹象，但改革的制度红利和信心提振确实值得期待。

预计全年 GDP 增长目标有望完成，稳增长政策力度有望继续加大但仍会维持定向调控，财税体制改革将加快，货币政策有望保持平稳，实体融资成本保持相对较高水平，地产政策逐步松绑。同时，房地产投资增速下滑、制造业产能过剩去产能将不可避免，信用违约风险有可能会逐渐暴露。下半年证券市场有望继续保持震荡。

在我国经济三期叠加期过程中，旧产业结构的调整和新经济支柱、新产业的培育是主要旋律。企业将主动采用并购重组、产业进退来优化自身资源配置，政府也会通过国企改革、重组整合等措施推动过剩产能消化和加快建立新产业。尤其是，并购转型在上半年已为企业和产业资本开启新的盈利模式，并购重组将是下半年的主要投资机会。



下半年，低股值的蓝筹板块将受益于国企改革、沪港通启动等政策带来的估值修复和资金面因素；成长性得到中报和三季度预告确认的新兴产业，以及新经济建立过程中大力培育的主题性新兴产业将继续表现较好。并购重组主题性投资机会将贯穿下半年。基于这样的判断，在下半年我们将积极持续优化、灵活操作，力争为持有人创造超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：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，本基金于 2014 年 4 月 14 日进行了收益分配，每 10 份基金份额合计派 0.20 元。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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

本报告期内，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。本报告期内，南方绩优成长股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，分配金额为114,243,359.83元。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方绩优成长股票型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：南方绩优成长股票型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	76,604,883.13	631,985,447.64
结算备付金	19,830,280.69	14,976,275.27
存出保证金	3,033,012.97	4,371,547.16
交易性金融资产	5,133,778,936.99	6,626,242,507.35
其中：股票投资	4,482,779,936.99	6,152,983,964.85
基金投资	-	-
债券投资	650,999,000.00	473,258,542.50
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,502,201,250.10	498,721,668.09
应收证券清算款	55,672,828.27	113,565,787.40
应收利息	8,882,459.59	5,584,149.12
应收股利	28,000.00	28,000.00

应收申购款	145,388.29	1,617,661.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,800,177,040.03	7,897,093,043.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2014年6月30日</b>	<b>2013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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	8,229,804.06	-
应付赎回款	8,007,013.68	6,742,589.79
应付管理人报酬	8,223,712.98	9,975,920.96
应付托管费	1,370,618.84	1,662,653.48
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,826,054.45	4,575,230.34
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	234,155.45	242,514.83
负债合计	29,891,359.46	23,198,909.40
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	5,622,686,728.41	6,110,266,014.79
未分配利润	1,147,598,952.16	1,763,628,119.63
所有者权益合计	6,770,285,680.57	7,873,894,134.42
负债和所有者权益总计	6,800,177,040.03	7,897,093,043.82

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2041 元，基金份额总额 5,622,686,728.41 份

## 6.2 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
<b>一、收入</b>	-288,761,473.57	599,102,878.80
1.利息收入	20,356,998.36	12,583,894.21
其中：存款利息收入	5,336,832.31	2,384,218.77
债券利息收入	7,390,486.93	6,245,163.82

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,629,679.12	3,954,511.62
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	839,111,925.75	416,544,878.94
其中：股票投资收益	803,021,413.37	354,786,137.44
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,399,366.69	4,055,657.31
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	34,691,145.69	57,703,084.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,148,619,874.61	169,855,481.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	389,476.93	118,623.76
<b>减：二、费用</b>	<b>82,087,903.31</b>	<b>96,119,942.91</b>
1. 管理人报酬	53,664,735.69	59,231,999.34
2. 托管费	8,944,122.61	9,871,999.94
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	19,226,559.56	26,786,855.37
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	252,485.45	229,088.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-370,849,376.88</b>	<b>502,982,935.89</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-370,849,376.88</b>	<b>502,982,935.89</b>

### 6.3 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,110,266,014.79	1,763,628,119.63	7,873,894,134.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-370,849,376.88	-370,849,376.88

期利润)			
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)	-487,579,286.38	-130,936,430.76	-618,515,717.14
其中：1.基金申购款	173,127,050.47	43,074,251.77	216,201,302.24
2.基金赎回款	-660,706,336.85	-174,010,682.53	-834,717,019.38
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)	-	-114,243,359.83	-114,243,359.83
五、期末所有者权益(基金净值)	5,622,686,728.41	1,147,598,952.16	6,770,285,680.57
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	502,982,935.89	502,982,935.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-392,694,959.55	-81,571,191.58	-474,266,151.13
其中：1.基金申购款	101,985,928.93	21,238,265.82	123,224,194.75
2.基金赎回款	-494,680,888.48	-102,809,457.40	-597,490,345.88
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)	6,445,743,162.37	1,272,954,005.13	7,718,697,167.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

邓见梁

邓见梁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

## 6.4.4 关联方关系

### 6.4.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
兴业证券	1,000,287,381.67	8.24%	1,537,474,915.63	8.95%
华泰证券	-	-	829,222,793.42	4.83%

### 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
华泰证券	-	-	8,632,800.00	28.19%

#### 6.4.5.1.2 权证交易

无

**6.4.5.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	-	-	-	-
兴业证券	885,153.94	8.15%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	737,366.92	4.77%	-	-
兴业证券	1,360,514.86	8.81%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**6.4.5.2 关联方报酬****6.4.5.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	53,664,735.69
其中：支付销售机构的客户维护费	6,449,545.04	7,212,097.40

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。

**6.4.5.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	8,944,122.61

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。

#### 6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	76,604,883.13	5,335,725.77	500,655,801.94	2,384,042.54

#### 6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 6.4.6 利润分配情况

##### 6.4.6.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2014年4月14日	2014年4月14日	0.2000	35,072,381.23	79,170,978.60	114,243,359.83	
合计	2014年4月14日	2014年4月14日	0.2000	35,072,381.23	79,170,978.60	114,243,359.83	

## 6.4.7 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
600703	三安光电	2014 年 1 月 30 日	2015 年 1 月 27 日	非公开发行流通受限	21.80	22.46	8,939,705	194,885,569.00	200,785,774.30	-
002466	天齐锂业	2014 年 3 月 12 日	2015 年 3 月 12 日	非公开发行流通受限	28.00	32.62	5,080,200	142,245,600.00	165,716,124.00	-
600885	宏发股份	2014 年 1 月 7 日	2015 年 1 月 3 日	非公开发行流通受限	15.00	18.33	7,000,000	105,000,000.00	128,310,000.00	-
603369	今世缘	2014 年 6 月 25 日	2014 年 7 月 3 日	新股流通受限	16.93	16.93	51,023	863,819.39	863,819.39	-
002727	一心堂	2014 年 6 月 25 日	2014 年 7 月 2 日	新股流通受限	12.20	12.20	34,975	426,695.00	426,695.00	-
603168	莎普爱思	2014 年 6 月 24 日	2014 年 7 月 2 日	新股流通受限	21.85	21.85	4,037	88,208.45	88,208.45	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

## 6.4.7.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002638	勤上光电	2014 年 6 月	重大事项	14.15	2014 年 7 月	14.75	2,200,591	27,766,068.28	31,138,362.65	-

		10 日	未公 告		15 日					
--	--	------	---------	--	------	--	--	--	--	--

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

### 6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.7.3.1 银行间市场债券正回购

无

#### 6.4.7.3.2 交易所市场债券正回购

无

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,482,779,936.99	65.92
	其中：股票	4,482,779,936.99	65.92
2	固定收益投资	650,999,000.00	9.57
	其中：债券	650,999,000.00	9.57
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,502,201,250.10	22.09
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	96,435,163.82	1.42
7	其他各项资产	67,761,689.12	1.00
8	合计	6,800,177,040.03	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,361,983,998.79	49.66

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,570,735.55	1.00
E	建筑业	16,200,000.00	0.24
F	批发和零售业	36,560,227.56	0.54
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	392,547,553.12	5.80
J	金融业	269,669,729.76	3.98
K	房地产业	146,180,433.41	2.16
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	-	-
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	192,067,258.80	2.84
S	综合	-	-
	合计	4,482,779,936.99	66.21

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600703	三安光电	16,939,705	388,225,774.30	5.73
2	002048	宁波华翔	13,143,883	195,843,856.70	2.89
3	002396	星网锐捷	6,824,448	191,016,299.52	2.82
4	600594	益佰制药	4,099,938	168,630,449.94	2.49
5	002466	天齐锂业	5,080,200	165,716,124.00	2.45
6	601166	兴业银行	14,999,979	150,449,789.37	2.22
7	300133	华策影视	4,699,984	150,164,488.80	2.22
8	000625	长安汽车	11,499,786	141,562,365.66	2.09
9	002236	大华股份	5,000,000	134,750,000.00	1.99
10	601877	正泰电器	6,029,539	132,107,199.49	1.95

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.nffund.com> 的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600109	国金证券	240,042,944.70	3.05
2	002396	星网锐捷	222,496,473.33	2.83
3	600703	三安光电	194,885,569.00	2.48
4	601166	兴业银行	155,668,435.38	1.98
5	300315	掌趣科技	154,232,178.22	1.96
6	002466	天齐锂业	142,245,600.00	1.81
7	002048	宁波华翔	142,067,938.10	1.80
8	000625	长安汽车	137,525,461.13	1.75
9	300133	华策影视	134,054,074.52	1.70
10	000001	平安银行	132,851,538.80	1.69
11	600446	金证股份	127,638,840.95	1.62
12	601992	金隅股份	127,445,908.74	1.62
13	002001	新和成	127,008,291.81	1.61
14	600104	上汽集团	125,821,233.68	1.60
15	000538	云南白药	125,491,422.01	1.59
16	600880	博瑞传播	117,731,586.11	1.50
17	600585	海螺水泥	110,428,013.16	1.40
18	600885	宏发股份	105,000,000.00	1.33
19	002285	世联行	103,189,533.34	1.31
20	600050	中国联通	99,998,408.33	1.27

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300070	碧水源	461,110,270.84	5.86
2	002415	海康威视	424,741,526.10	5.39

3	601318	中国平安	396,160,576.18	5.03
4	002236	大华股份	329,438,977.76	4.18
5	600406	国电南瑞	226,629,668.48	2.88
6	000917	电广传媒	200,893,542.99	2.55
7	000977	浪潮信息	186,017,064.46	2.36
8	300226	上海钢联	174,395,537.70	2.21
9	600686	金龙汽车	154,028,607.23	1.96
10	600887	伊利股份	150,193,773.16	1.91
11	002008	大族激光	148,231,884.15	1.88
12	000001	平安银行	138,793,454.19	1.76
13	002241	歌尔声学	138,139,947.10	1.75
14	600109	国金证券	125,494,723.89	1.59
15	600690	青岛海尔	122,273,686.60	1.55
16	603000	人民网	119,222,977.13	1.51
17	600585	海螺水泥	117,831,951.29	1.50
18	300014	亿纬锂能	110,678,597.10	1.41
19	600436	片仔癀	109,564,133.67	1.39
20	000538	云南白药	108,134,533.54	1.37

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,662,279,127.85
卖出股票收入（成交）总额	6,986,716,405.75

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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	339,633,000.00	5.02
	其中：政策性金融债	339,633,000.00	5.02
4	企业债券	311,366,000.00	4.60
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	650,999,000.00	9.62

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	169,524,000.00	2.50
2	130243	13 国开 43	1,500,000	150,165,000.00	2.22
3	041352041	13 京能 CP001	500,000	50,490,000.00	0.75
4	011410003	14 中电投 SCP003	500,000	50,170,000.00	0.74
5	011490002	14 苏交通 SCP002	500,000	50,105,000.00	0.74

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 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	3,033,012.97
2	应收证券清算款	55,672,828.27
3	应收股利	28,000.00
4	应收利息	8,882,459.59
5	应收申购款	145,388.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,761,689.12

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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	600703	三安光电	200,785,774.30	2.97	非公开发行
2	002466	天齐锂业	165,716,124.00	2.45	非公开发行

注：本基金本报告期末前十名股票除上述股票不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
244,816	22,966.99	156,859,430.00	2.79%	5,465,827,298.00	97.21%

### 8.2 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, 274, 782. 30	0. 0227%
------------------	-----------------	----------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	本基金基金经理没有持有本开放式基金

## § 9 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, 110, 266, 014. 79
本报告期基金总申购份额	173, 127, 050. 47
减：本报告期基金总赎回份额	660, 706, 336. 85
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	5, 622, 686, 728. 41

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	2,262,029,834.63	18.64%	2,036,983.06	18.77%	-
中投证券	1	1,214,172,339.52	10.01%	1,074,421.88	9.90%	-
申银万国	1	1,160,780,357.66	9.57%	1,027,175.78	9.46%	-
中信建投	2	1,039,487,530.49	8.57%	919,843.83	8.47%	-
兴业证券	1	1,000,287,381.67	8.24%	885,153.94	8.15%	-
国泰君安	2	974,363,890.13	8.03%	862,216.23	7.94%	-
华创证券	1	767,010,546.75	6.32%	678,729.60	6.25%	-
招商证券	2	685,147,508.01	5.65%	622,123.85	5.73%	-
海通证券	2	668,160,178.46	5.51%	608,292.15	5.60%	-
齐鲁证券	2	521,767,838.11	4.30%	475,018.44	4.38%	-
联讯证券	1	510,780,758.80	4.21%	465,015.02	4.28%	-
华鑫证券	1	484,178,973.94	3.99%	440,795.21	4.06%	-
东北证券	1	416,462,326.77	3.43%	368,528.04	3.40%	-
宏源证券	2	334,136,741.63	2.75%	304,197.41	2.80%	-
东吴证券	1	94,218,560.77	0.78%	85,775.99	0.79%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华宝经纪	1	-	-	-	-	-

大同证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-

注：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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

中信证券	-	-	5,985,100,000.00	36.83%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	44,432,128.30	59.54%	259,100,000.00	1.59%	-	-
齐鲁证券	-	-	6,212,000,000.00	38.23%	-	-
联讯证券	30,199,303.69	40.46%	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	2,220,000,000.00	13.66%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	1,200,000,000.00	7.39%	-	-
东吴证券	-	-	372,900,000.00	2.29%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华宝经纪	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-