南方多利增强债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年8月27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2013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2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方多利增强债券	
基金主代码	202102	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年8月28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	2,143,690,398.85份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方多利增强债券A	南方多利增强债券C
下属分级基金的交易代码:	202103	202102
报告期末下属分级基金的份额总额	1,188,134,737.18份	955,555,661.67份

注:1.本基金系原南方多利中短期债券投资基金于2007年8月28日转型而来。
2.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“南方多利”。
3.本基金自2009年9月23日起增加A类收费模式,原有收费模式称为C类。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于债券型基金,投资目标是在债券稳定收益的基础上,通过股票一级市场申购等投资手段积极投资获取高于投资基准的收益。
投资策略	(一)债券投资策略 首先我们根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期和债券组合结构;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中,我们采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。 (二)新股投资策略 目前股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差,新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金通过对宏观经济以及上市公司的基本面深入研究,并结合金融工程数量化模型,对于拟发行上市的新股等权益类资产进行合理估值,制定相应的申购和择时卖出策略。
业绩比较基准	中央国债登记结算公司中债总指数(全价)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,预期收益高于货币市场基金,风险低于混合型基金。

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

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

基金级别	南方多利增强债券A	南方多利增强债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	64,325,230.54	34,389,513.22
本期利润	64,042,454.70	32,503,467.39
加权平均基金份额本期利润	0.0315	0.0277
本期基金份额净值增长率	3.37%	3.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0394	0.0362
期末基金资产净值	1,281,896,044.94	1,027,789,067.66
期末基金份额净值	1.0789	1.0756

注:1.本基金系原南方多利中短期债券投资基金于2007年8月28日转型而来。
2.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。
3.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)。
4.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。

5. 本基金自2009年9月23日起增加A类收费模式,原有收费模式称为C类。

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

南方多利增强债券A

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	-0.62%	0.20%	-0.70%	0.22%	0.08%	-0.02%
过去三个月	0.78%	0.12%	0.03%	0.13%	0.75%	-0.01%
过去六个月	3.37%	0.10%	0.47%	0.10%	2.90%	0.00%
过去一年	4.32%	0.10%	-0.98%	0.08%	5.30%	0.02%
过去三年	18.68%	0.25%	-0.58%	0.10%	19.26%	0.15%
自基金转型以来	25.28%	0.26%	1.14%	0.09%	24.14%	0.17%

南方多利增强债券C

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	-0.64%	0.20%	-0.70%	0.22%	0.06%	-0.02%
过去三个月	0.72%	0.12%	0.03%	0.13%	0.69%	-0.01%
过去六个月	3.22%	0.10%	0.47%	0.10%	2.75%	0.00%
过去一年	4.01%	0.10%	-0.98%	0.08%	4.99%	0.02%
过去三年	17.62%	0.25%	-0.58%	0.10%	18.20%	0.15%
自基金转型以来	35.51%	0.25%	6.27%	0.13%	29.24%	0.12%

3.2.2 自基金转型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

注:1. 本基金系原南方多利中短期债券投资基金于2007年8月28日转型而来。
2. 本基金自2009年9月23日起增加A类收费模式,原有收费模式称为C类。
3. 本基金建仓期为一个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。2010年,经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场(集团)有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。公司在北京、上海、合肥等地设有分公司,在香港设有子公司--南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末,公司管理资产规模超过2,000亿元,旗下管理42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		
李璇	本基金基金经理	2010年9月21日	-	5	女,清华大学金融学学士、硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2007年加入南方基金,担任信用债高级分析师,现任固定收益部总监助理。2010年9月至2012年6月,担任南方宝元基金经理;2010年9月至今,担任南方多利基金经理;2012年5月至今,担任南方金利基金经理;2012年12月至今,担任南方安心基金经理;2013年7月至今,担任南方稳利基金经理。

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、《南方多利增强债券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1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

上半年中国经济的复苏力度连续低于预期,政府对经济下滑的容忍度明显提高,通胀压力不大,一季度外汇占款新增较多,导致整体资金面偏松。在经济数据不及预期和资金面非常充裕的环境下,1-5月份债券市场收益率以下降为主,其中4月中下旬受债市监管风暴影响,中低评级信用债经历了一个短期大幅震荡。6月份资金面趋紧,导致债券市场收益率全面大幅上行,直至月末最后几天才开始有所恢复。可转债在经历了1月份的上涨之后,呈震荡下行走势,其中6月份受流动性压力和股票下跌的双重影响,下跌幅度较大。

投资运作上,南方多利增强基金上半年的投资仍以信用债为主,在享有较好的票息收益外还获取了一定的价差收益。随着信用市场的上涨、信用利差的缩窄,以及基于对市场过于宽松的流动性的担心,我们对信用债的结构进行了调整,以防范可能出现的市场风险和流动性风险。可转债投资方面,我们坚持稳健投资的理念,主要选择估值有安全边际的品种进行投资,为组合贡献了一定的正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期南方多利增强A级基金净值增长率为3.37%,同期业绩比较基准增长率为0.47%;南方多利增强C级基金净值增长率为3.22%,同期业绩比较基准增长率为0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年中国经济疲弱态势仍将延续,微观层面企业的经营状况仍难有明显改善,但经济增速“下限”引导的政府局部刺激以及外需的企稳将对房地产投资和制造业投资的下滑有对冲作用。物价水平仍处于政府目标区间内,通胀压力不明显,但在猪周期缓慢启动和基数效应的影响下,CPI同比将缓步回升,四季度预计达到3%左右。央行将继续维持中性的货币政策,并通过逆回购等手段稳定市场对资金面的预期,上半年极度宽松的资金面难以再现,但6月份这种资金面极度紧张的局面也不会再发生。基于经济疲弱和通胀压力不大的判断,我们认为利率债风险不大,下半年有波段操作的机会,南方多利增强基金将以部分仓位参与利率债的波段;信用债仍然将是南方多利增强基金的主要投资品种,但由于目前信用利差较低,不能反映当前企业盈利能力下滑、信用资质变弱的情况,并且审计署全面审计政府债务对城投债的影响也具有一定的不确定性,我们下阶段将谨慎选择信用状况较好的公司和债券进行投资。转债方面,我们认为在经历了6月份的下跌之后,转债配置价值明显上升,但趋势性机会仍然取决于股票市场,南方多利增强基金在转债操作上将较上半年更为积极,争取把握股市波动带来的阶段性机会,同时仍将坚持稳健投资的理念,以获取绝对收益为目标,注重下行风险的控制。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、数量化投资部总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制订的相关制度,负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,本基金的收益分配原则为: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,投资者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,本报告期本基金未有分配事项。本报告期内2013年1月16日已分配数(A类每10份基金份额派发红利0.22元,C类每10份基金份额派发红利0.20元)为以往年度收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对南方多利增强债券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,南方多利增强债券型证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方多利增强债券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,南方多利增强债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为45,055,620.36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多利增强债券型证券投资基金2013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:南方多利增强债券型证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		77,101,557.63	1,307,868.83
结算备付金		20,633,720.93	56,680,344.50
存出保证金		207,889.42	250,000.00
交易性金融资产		4,090,469,930.52	2,169,440,785.58
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,090,469,930.52	2,169,440,785.58
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		93,171,200.00	7,113,031.33
应收利息		76,279,002.13	35,602,156.23
应收股利		-	-
应收申购款		2,437,354.97	57,488,389.85
递延所得税资产		-	-
其他资产		150,000.00	-
资产总计		4,360,450,655.60	2,327,882,576.32

负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30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		-	-
卖出回购金融资产款		1,964,077,069.72	427,999,650.00
应付证券清算款		39,751,762.76	-
应付赎回款		42,439,029.18	9,187,537.15
应付管理人报酬		1,754,511.52	901,150.70
应付托管费		584,837.18	300,383.55
应付销售服务费		347,123.32	230,797.38
应付交易费用		42,178.49	87,857.70
应交税费		-	-
应付利息		1,328,213.31	82,710.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		440,817.52	639,146.71
负债合计		2,050,765,543.00	439,429,233.93
所有者权益:			
实收基金		2,143,690,398.85	1,774,988,937.82
未分配利润		165,994,713.75	113,464,404.57
所有者权益合计		2,309,685,112.60	1,888,453,342.39
负债和所有者权益总计		4,360,450,655.60	2,327,882,576.32

注:报告截止日2013年6月30日,A类基金的份额净值1.0789元,C类基金的份额净值1.0756元,基金份额总额2,143,690,398.85份,其中A类基金份额1,188,134,737.18份,C类基金份额955,555,661.67份。

6.2 利润表

会计主体:南方多利增强债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		118,491,701.11	125,555,015.93
1.利息收入		81,940,009.79	31,604,470.09
其中:存款利息收入		437,309.38	269,869.26
债券利息收入		78,059,679.21	31,265,962.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,443,021.20	68,638.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		38,078,627.03	32,592,947.89
其中:股票投资收益		9,710.64	14,733,689.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益		38,068,916.39	17,841,438.79
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	17,820.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-2,168,821.67	61,118,836.25
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		641,885.96	238,761.70
减:二、费用		21,945,779.02	10,411,399.37
1.管理人报酬	6.4.5.2.1	10,166,874.13	3,574,437.06
2.托管费	6.4.5.2.2	3,388,958.06	1,191,479.05
3.销售服务费	6.4.5.2.3	1,861,486.79	1,209,561.13
4.交易费用		78,254.43	258,484.32
5.利息支出		6,203,260.46	3,941,205.48
其中:卖出回购金融资产支出		6,203,260.46	3,941,205.48
6.其他费用		246,945.15	236,232.33
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		96,545,922.09	115,143,616.56
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		96,545,922.09	115,143,616.56

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方多利增强债券型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,774,988,937.82	113,464,404.57	1,888,453,342.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	96,545,922.09	96,545,922.09
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)	368,701,461.03	1,040,007.45	369,741,468.48
其中:1.基金申购款	5,806,590,598.32	395,951,643.77	6,202,542,242.09
2.基金赎回款	-5,437,889,137.29	-394,911,636.32	-5,832,800,773.61
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)	-	-45,055,620.36	-45,055,620.36
五、期末所有者权益(基金净值)	2,143,690,398.85	165,994,713.75	2,309,685,112.60

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	783,300,245.91	11,538,354.40	794,838,600.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	115,143,616.56	115,143,616.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,260,886,293.20	94,026,172.12	1,354,912,465.32
其中:1.基金申购款	2,906,091,880.22	200,467,385.14	3,106,559,265.36
2.基金赎回款	-1,645,205,587.02	-106,441,213.02	-1,751,646,800.04
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)	-	-68,018,332.98	-68,018,332.98
五、期末所有者权益(基金净值)	2,044,186,539.11	152,689,810.10	2,196,876,349.21

注: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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有须说明的会计差错更正。

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。

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派发利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税,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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

④)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.4 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
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
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、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

无。

6.4.5.1.2 债券交易

无。

6.4.5.1.3 债券回购交易

无。

6.4.5.1.4 权证交易

无。

6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,166,874.13	3,574,437.06
其中:支付销售机构的客户维护费	1,542,804.48	437,348.23

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0.6%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.6% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,388,958.06	1,191,479.05

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0.2%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 0.2% / 当年天数。

6.4.5.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方多利增强债券A	南方多利增强债券C	合计
南方基金	-	734,440.74	734,440.74
中国工商银行	-	389,565.33	389,565.33
华泰证券	-	12,109.97	12,109.97
兴业证券	-	2,960.10	2,960.10
合计	-	1,139,076.14	1,139,076.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方多利增强债券A	南方多利增强债券C	合计
南方基金	-	497,462.69	497,462.69
中国工商银行	-	292,164.41	292,164.41
华泰证券	-	5,697.20	5,697.20
兴业证券	-	2,088.47	2,088.47
合计	-	797,412.77	797,412.77

注:支付C类基金份额销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.3%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金,再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.3% / 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

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	82,177,974.65	10,057,519.32	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	51,397,213.11	86,911,606.39	-	-	-	-

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	南方多利增强债券A	南方多利增强债券C	合计
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	南方多利增强债券A	南方多利增强债券C	合计
期初持有的基金份额	-	76,883,793.74	76,883,793.74
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	49,000,000.00	49,000,000.00
期末持有的基金份额	-	27,883,793.74	27,883,793.74
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.56%	1.36%

注:期间申购总份额含红利再投、转换入份额,期间赎回总份额含转换出份额。

6.4.5.4.2 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

无。

6.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	77,101,557.63	206,711.25	9,281,284.41	135,263.96

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张)	总金额
兴业证券	112156	12中顺债	新债分销	140,000	14,000,000.00
兴业证券	1380088	13三明城投债	新债分销	100,000	10,000,000.00
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张)	总金额
华泰联合证券	1280138	12许昌投资债	新债分销	100,000	10,000,000.00
兴业证券	1280098	12长建投债	新债分销	200,000	20,000,000.00
华泰联合证券	1280027	12鞍山城投债	新债分销	100,000	10,000,000.00

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有须作说明的其他关联交易事项。

6.4.6 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 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
无										

6.4.9.1.2 受限证券类别:债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
112180	12奥飞债	2013年6月14日	2013年7月23日	新债申购	100.00	100.00	270,000	27,000,000.00	27,000,000.00	-

6.4.9.1.3 受限证券类别:权证

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
无										

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额847,177,169.22元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |