南方广利回报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	南方广利回报债券	
基金主代码	202105	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年11月3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	1,046,785,261.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C
下属分级基金的交易代码:	202105	202107
下属分级基金的前端交易代码	202105	–
下属分级基金的后端交易代码	202106	–
报告期末下属分级基金的份额总额	561,310,540.46份	485,474,720.87份

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"南方广利"。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持资产流动性及有效控制风险的基础上,追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金管理人将以经济周期和宏观政策分析为前提,综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在债券、股票、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

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

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	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券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	46,488,448.59	37,909,088.85
本期利润	18,273,318.09	12,745,034.18
加权平均基金份额本期利润	0.0245	0.0207
本期基金份额净值增长率	2.07%	1.89%
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	0.0666	0.0555
期末基金资产净值	604,072,947.27	517,066,219.78
期末基金份额净值	1.076	1.065

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

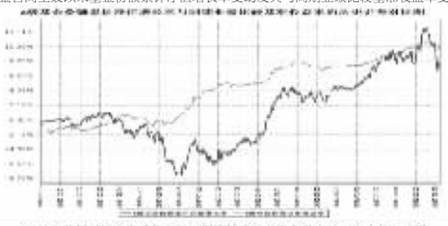
南方广利回报债券A/B

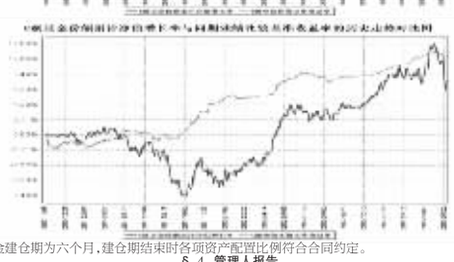
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.19%	0.67%	-0.38%	0.16%	-3.81%	0.51%
过去三个月	-0.65%	0.52%	0.98%	0.10%	-1.63%	0.42%
过去六个月	2.07%	0.46%	2.42%	0.08%	-0.35%	0.38%
过去一年	4.12%	0.36%	2.84%	0.07%	1.28%	0.29%
自基金合同生效起至今	8.60%	0.35%	11.08%	0.11%	-2.48%	0.24%

南方广利回报债券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	-4.23%	0.67%	-0.38%	0.16%	-3.85%	0.51%
过去三个月	-0.75%	0.53%	0.98%	0.10%	-1.73%	0.43%
过去六个月	1.89%	0.46%	2.42%	0.08%	-0.53%	0.38%
过去一年	3.76%	0.36%	2.84%	0.07%	0.92%	0.29%
自基金合同生效起至今	7.50%	0.35%	11.08%	0.11%	-3.58%	0.24%

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





注:本基金建仓期为六个月,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金字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。2010年,经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场(集团)有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。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		
韩亚庆	本基金的基金经理	2010年11月3日	-	12	经济学硕士,具有基金从业资格。2000年开始从事固定收益类证券承销、研究与投资管理,曾任职于国家开发银行资金局、全国社会保障基金理事会投资部。2008年加入南方基金,2010年5月至今,担任固定收益部副总监、执行总监;2008年11月至今,任南方现金基金经理;2010年11月至今,任南方广利基金经理;2013年4月至今,任南方永利基金经理。

注:1.此处的任职日期指基金合同生效日。

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、《南方广利回报债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 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

从当前经济数据和一定的政策信号看,经济政策的重心在于调结构、促转型和防风险,对稳增长和控通胀似乎有所淡化。相对于10年前的2003年,2013年的中国在出口优势和投资空间上都出现了事实上的显著回落,GDP增速已悄然从9%-10%的空间回落到7%-8%,潜在的增长速度已然下降,而调结构、促转型需要时间,防风险实际上是在加强对前期表外融资和地方政府平台融资的控制,降低了过渡杠杆风险,但在利用行政手段和市场手段时,需避免政策叠加的负效应,同时做到疏堵结合。毕竟我们的经济增长动能已不足,主动降低原有需求,在新增需求未形成和总量不够,或是新的供给能力未有效建立前,经济有短期下滑过快的风险。从微观层面看,二季度以来企业亏损面加大,如果说水泥、钢铁大面积亏损主要反映产能过剩,今年多地煤炭行业持续亏损更反映了经济领域已实质转冷,加之出口受汇率高估、国内劳动力成本已丧失优势等影响增速微弱,我们担心在目前的政策目标下,经济增长的下行风险较大,同时对期限性行业要通过快过多的情况重视不够。尽管由于人口结构问题,短期失业高不明显,但我们认为需要密切关注周期性行业持续亏损现象,周期性行业多为国有企业,一时的亏损可以由当地财政补贴,但持续两到三年的大面积亏损,会使财政无力补助,企业失去外部救助最终会导致破产风险和较大规模的失业,同时银行的坏账会显现,债券市场的风险也会暴露。如果没有经济增长的底线意识,我们担心这一局面可能在明年或后年就能看到。因此,我们认为政策在稳增长方面会有所准备,会有一个根据对经济数据的观察和经济运行情况进行应对的过程。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

从上半年情况看,债券市场在5月下旬前走势较好,之后由于市场资金利率大幅走高,债市开始调整。由于出现亏损或者被下调信用评级,二季度后期债券市场信用风险加大,中低评级信用债出现较大幅度的调整。股票和可转债市场在春节前延续了去年12月末的上涨,但二季度特别是6月大幅下跌,同时市场分化严重,创业板和中小板涨幅突出,沪深300和上证指数则出现下跌。从上半年情况,中债综合财富指数上涨2.34%,中债企业债财富指数上涨3.86%,沪深300指数下跌12.78%,中证转债指数上涨1.85%。

本报告期A/B级基金净值收益率为2.07%,同期业绩比较基准收益率为2.42%。C级基金净值收益率为1.89%,同期业绩比较基准收益率为2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从上半年广利基金的实际操作看,仍以信用债券作为债券持有的重点,并注重期限和收益率的合理匹配,不盲目增加组合久期和仓位,注重对组合持仓进行期限和信用的动态调整。从股票和转债操作看,积极把握市场和行业提供的市场机会,股票和转债保持了较高仓位。

展望下半年,我们预计债券市场将呈现结构性的特点,利率产品和高等级债券应优于中低等级,特别要注意防范信用风险,计划积极调仓以降低组合的信用风险。对股票市场,我们认为从中长期看,上证指数在2000点以下提供了好的投资机会,三季度股票预计将在较长时间内维持低位,在新股重启和经济、政策不确定消除后,下半年市场将稳步向上,我们对下半年的股票市场较乐观,并将积极把握行业,以及新股重启后的机会。广利基金将继续以经济、政策和市场三者关系为研究分析重点,将在最新市场环境下通过大类资产选择和配置,建立多策略和总回报投资思路,在控制基金下行风险的基础上,为基金积极创造正收益来源,为投资者累计正回报。

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、会规、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:由于本基金A类/B类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一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,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的10%;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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)不得超过15个工作日。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2013年2月22日进行了收益分配,各类份额每10份基金份额派0.10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广利回报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,南方广利回报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广利回报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,南方广利回报债券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16,305,309.90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广利回报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:南方广利回报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	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	42,426,977.60	36,511,767.19
结算备付金	46,561,200.12	34,677,617.89
存出保证金	404,994.35	1,667,499.52
交易性金融资产	1,802,918,285.14	1,984,865,762.92
其中:股票投资	201,135,981.80	249,789,031.85
基金投资	-	-
债券投资	1,601,782,303.34	1,735,076,731.07
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	-	83,967,168.12
应收利息	30,520,966.70	35,917,803.69
应收股利	223,692.32	-
应收申购款	808,986.04	3,071,773.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,923,865,102.27	2,180,679,392.57
负债和所有者权益	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	758,998,906.40	756,882,474.56
应付证券清算款	17,248,236.55	-
应付赎回款	24,457,628.59	117,764,364.51
应付管理人报酬	661,354.03	773,750.85
应付托管费	203,493.55	238,077.18
应付销售服务费	195,434.96	231,247.39
应付交易费用	385,899.44	1,045,768.10
应交税费	-	-
应付利息	356,973.36	172,475.40
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	218,008.34	431,451.37
负债合计	802,725,935.22	877,539,609.36
所有者权益:		
实收基金	1,046,785,261.33	1,229,641,289.81
未分配利润	74,353,905.72	73,498,493.40
所有者权益合计	1,121,139,167.05	1,303,139,783.21
负债和所有者权益总计	1,923,865,102.27	2,180,679,392.57

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额总额1,046,785,261.33份,其中A/B类基金份额的份额总额为561,310,540.46份,份额净值1.076元;C类基金份额的份额总额为485,474,720.87份,份额净值1.065元。

6.2 利润表

会计主体:南方广利回报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	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	53,207,502.25	160,052,101.63
1.利息收入	44,610,230.87	42,280,438.54
其中:存款利息收入	469,428.70	289,306.92
债券利息收入	44,140,802.17	41,962,287.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	28,844.38
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	61,606,021.55	-57,144,786.20
其中:股票投资收益	34,894,418.48	-45,279,394.18
基金投资收益	-	-
债券投资收益	24,798,454.21	-12,937,248.22
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,913,148.86	1,071,856.20
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-53,379,185.17	174,619,621.44
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	370,435.00	296,827.85
减:二、费用	22,189,149.98	19,137,150.96
1.管理人报酬	4,734,608.47	4,629,669.40
2.托管费	1,456,802.64	1,424,513.69
3.销售服务费	1,313,383.36	1,418,575.86
4.交易费用	1,879,714.48	2,118,406.86
5.利息支出	12,583,130.86	9,323,892.84
其中:卖出回购金融资产支出	12,583,130.86	9,323,892.84
6.其他费用	221,510.17	222,092.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	31,018,352.27	140,914,950.67
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	31,018,352.27	140,914,950.67

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方广利回报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)	1,229,641,289.81	73,498,493.40	1,303,139,783.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,018,352.27	31,018,352.27
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)	-182,856,028.48	-13,857,630.05	-196,713,658.53
其中:1.基金申购款	1,116,523,298.09	92,936,335.34	1,209,459,633.43
2.基金赎回款	-1,299,379,326.57	-106,793,965.39	-1,406,173,291.96
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)	-	-16,305,309.90	-16,305,309.90
五、期末所有者权益(基金净值)	1,046,785,261.33	74,353,905.72	1,121,139,167.05
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)	1,491,398,596.57	-92,258,959.58	1,399,139,636.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	140,914,950.67	140,914,950.67
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)	249,776,799.06	19,678,894.97	269,455,694.03
其中:1.基金申购款	845,768,708.69	21,347,490.53	867,116,199.22
2.基金赎回款	-595,991,909.63	-1,668,595.56	-597,660,505.19
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)	1,741,175,395.63	68,334,886.06	1,809,510,281.69

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 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。

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
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

金额单位: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	
	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	-	-	1,297,911,236.46	95.94%

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	-	-	525,545,013.01	95.44%

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	-	-	20,341,000,000.00	92.19%

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 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	-	-	-	-
	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	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	1,084,257.98	95.87%	1,614,040.65	97.19%

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 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	4,734,608.47	4,629,669.40
其中:支付销售机构的客户维护费	1,106,571.38	1,574,768.79

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0.65%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 X0.65% / 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	1,456,802.64	1,424,513.69

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		
	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C	合计
南方基金公司	-	45,207.72	45,207.72
中国工商银行	-	173,166.92	173,166.92
华泰证券	-	4,295.62	4,295.62
兴业证券	-	69.35	69.35
合计	-	222,739.61	222,739.61
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		
	南方广利回报债券A/B	南方广利回报债券C	合计
南方基金公司	-	33,566.10	33,566.10
中国工商银行	-	873,741.42	873,741.42
华泰证券	-	16,501.45	16,501.45
兴业证券	-	725.29	725.29
合计	-	924,534.26	924,534.26

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0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金公司,再由南方基金公司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 0.4% / 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	10,004,142.47	-	-	-	-	-
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	-	10,571,456.34	-	-	-	-

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

无。

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	42,426,977.60	87,251.63	19,392,637.29	118,276.16

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:份)	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:份)	总金额
兴业证券	122156	12厦工债	新债分销	140,000	14,000,000.00
华泰联合证券	1280151	12沪地产债	新债分销	100,000	10,000,000.00
华泰证券	1282027	12兖矿MTN1	新债分销	300,000	30,000,000.00

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无

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

6.4.12.1.2 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
124307	13安经开	2013年6月19日	2013年7月22日	新债分销	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-

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

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279,998,970.00元,是以如下债券作为抵押:

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
0980159	09衡城投债	2013年7月1日	104.15	500,000	52,075,000.00
1080009	10泰州债	2013年7月1日	102.03	300,000	30,609,000.00
1080122	10徐州债	2013年7月1日	101.07	100,000	10,107,000.00
1282089	12南山集MTN1	2013年7月1日	101.21	300,000	30,363,000.00
1280147	12桂林债	2013年7月1日	103.05	10,000	1,030,500.00
120228	12国开28	2013年7月3日	99.95	500,000	49,975,000.00
1080075	10饶城投债	2013年7月3日	101.18	400,000	40,472,000.00
1280331	12张家界经投债	2013年7月3日	103.77	160,000	16,603,200.00
1