

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

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，也不保证基金份额持有人及时足额收到赎回款项。基金管理人不对因基金资产净值波动而造成的损失承担责任。

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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2013年01月01日起至06月30日止。

§ 2 基金简介	
2.1 基金基本情况	
基金简称	南方恒元保本混合
基金主代码	202211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月12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	2,789,994,682.70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“南方恒元”。	
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，为投资者提供认购保本金额/申购保本金额的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金资产配置策略分为两个层次：一层为对风险资产和无风险资产的配置，该层次以恒定比例组合保险策略为依据，即风险资产部分所能承受的损失最大不能超过无风险资产部分所产生的收益；另一层为对风险资产部分的配置策略。基金管理人将根据情况对这两个层次的策略进行调整。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

2.3 基金管理人/基金托管人	
项目	基金管理人
名称	南方基金管理有限公司
姓名	陶文萃
联系电话	0755-82763888
电子邮箱	imanager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899
传真	0755-82763889
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	报告期末(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	69,945,270.56
本期公允价值变动收益	47,517,139.55
加权平均基金份额本期利润	0.0155
期末基金份额净值增长率	1.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末基金资产净值	2,891,838,183.03
期末基金份额净值	1.037

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。

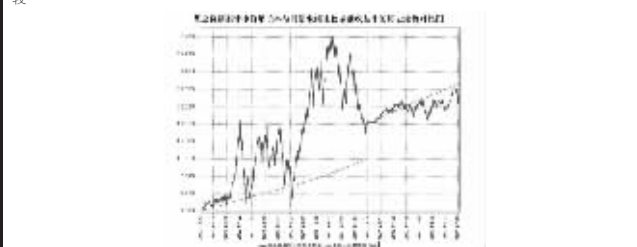
2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低者(仍期末余额，不超过当期发生数)。

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率将低于所列数字。

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	-1.43%	0.32%	0.33%	0.01%	-1.76%	0.31%
过去三个月	2.27%	0.25%	1.00%	0.01%	1.27%	0.24%
过去六个月	1.56%	0.26%	2.01%	0.01%	-0.45%	0.25%
过去一年	1.56%	0.26%	4.14%	0.01%	-2.58%	0.25%
过去三年	19.00%	0.60%	12.97%	0.01%	6.03%	0.59%
自基金合同生效起至今	24.62%	0.70%	19.17%	0.01%	5.45%	0.69%



注：本基金建仓期为六个月，建仓期间内各项资产配置比例符合合同约定。本基金的第一个保本期为三年，自2008年11月2日至2011年1月14日止；第二个保本期为三年，自2011年12月13日至2014年12月13日止。

§ 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金字[1998]4号文批准，由南方证券股份有限公司、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%。公司在上海、深圳、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。

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	
陈东	本基金基金经理	2012-12-14		清华大学数学物理学博士，具有基金从业资格，2008年7月加入南方基金，担任南方基金研究部机械行业研究员，2010年10月至2012年12月，担任南方稳健和南稳贰号的基金经理助理，2012年12月至今，任南方恒元基金经理。

注：1、对基金的曾任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，解聘日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后非曾任基金经理，其“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、证书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、《南方恒元保本混合型证券投资基金基金合同》及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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。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约定。

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中公平交易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，是由于指数型基金跟踪标的指数波动所致。

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2季度，A股市场呈现出明显的分化格局。以创业板为代表的新兴行业相关股票大涨，而金融、地产以及投资相关股票则普遍下跌。流动性持续充裕，悲观情绪的走弱态势，对政府刺激政策预期的落空，加上对经济转型的美好预期导致了这一分化格局的出现。但自6月开始，流动性出现了紧张，预计未来Q3出现的短期流动性紧张，下半年流动性会趋于上半年。我们在2013年上半年重点投资了电子元件行业和医药运输行业的蓝筹股，维持持有白酒龙头企业。由于市场偏好小盘股，资金不断向中小盘聚集，因此上半年表现一般。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.037，报告期内，净值增长率为1.56%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，我们认为宏观经济仍无起色，而流动性方面则面临央行Q3退出导致国际资本流出的风险。虽然长期来看流动性仍将充裕，但我们认为大规模刺激政策可能性不大，更多的资金将寻找结构性的短期进行局部投资，比如医药和电网。许多大盘股曾经经过2季度的下跌，已充分反应悲观预期，无论从估值水平还是股息率角度都已极具投资价值。我们将通过持续挖掘并坚定持有被低估的具有核心竞争力的公司，努力为本基金持有人创造良好回报。

4.4.4 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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值技术、估值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，本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展，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，根据基金管理人制订的相关制度，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。

4.4.5 管理人对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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值技术、估值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，本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展，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，根据基金管理人制订的相关制度，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。

4.4.6 管理人对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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值技术、估值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，本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展，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，根据基金管理人制订的相关制度，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。

4.4.7 管理人对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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值技术、估值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，本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展，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，根据基金管理人制订的相关制度，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。

4.4.8 管理人对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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值技术、估值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，本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展，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，根据基金管理人制订的相关制度，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。

4.4.9 管理人对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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值技术、估值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，本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展，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，根据基金管理人制订的相关制度，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。

4.4.10 管理人对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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值技术、估值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，本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展，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，根据基金管理人制订的相关制度，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。

4.4.11 管理人对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规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所应在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值技术、估值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，本基金管理人为了保障估值工作的顺利开展，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，根据基金管理人制订的相关制度，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。

2013 半年度报告摘要

5.3 管理人对本半年度报告中财务信息等相关信息的真实、准确和完整发表意见

5.3 管理人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方恒元保本混合型证券投资基金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：南方恒元保本混合型证券投资基金	
报告截止日：2013年6月30日	

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	12,507,084.18	32,229,576.53
结算备付金	1,846,849.86	42,770.36
应收保证金	299,952.26	405,273.73
交易性金融资产	2,846,656,710.76	3,120,000,755.54
其中：股票投资	389,604,204.26	566,805,300.64
基金投资	-	-
债券投资	2,457,052,506.50	2,553,195,454.90
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	149,900,349.85
应收证券清算款	-	80,409,403.74
应收利息	43,465,213.14	32,222,390.33
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	15,000.00	-
资产总计	2,904,790,810.20	3,414,850,520.08

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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	8,692,719.05	12,879,369.68
应付管理人报酬	3,179,664.34	3,733,171.23
应付托管费	489,179.11	574,334.02
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	326,854.74	152,876.02
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	264,209.93	601,633.13
负债合计	12,952,627.17	17,941,384.08
所有者权益：		
实收基金	2,783,910,999.97	3,296,484,244.14
未分配利润	107,927,183.06	100,424,891.86
所有者权益合计	2,891,838,183.03	3,396,909,136.00
负债和所有者权益总计	2,904,790,810.20	3,414,850,520.08

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.037元，基金份额总额2,789,994,682.70份。

6.2 利润表

会计主体：南方恒元保本混合型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

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	73,477,283.66	138,035,803.17
1.利息收入	51,349,767.90	71,074,540.35
其中：存款利息收入	185,718.28	245,086.87
债券利息收入	50,796,613.88	69,896,104.85
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	367,435.74	933,348.63
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	42,084,364.31	30,734,071.08
其中：股票投资收益	23,088,317.72	25,498,444.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,914,573.60	3,586,543.09
资产支持证券投资	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,081,472.99	1,649,083.35
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-22,428,131.01	34,843,215.88
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,241,482.26	1,383,975.86
减：二、费用	25,960,144.11	30,956,259.38
1.管理人报酬	20,384,803.38	25,091,739.49
2.托管费	3,136,123.56	3,860,267.58
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,844,409.83	1,755,114.55
5.利息支出	378,256.17	34,403.74
其中：卖出回购金融资产支出	378,256.17	34,403.74
6.其他费用	216,551.17	214,734.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	47,517,139.55	107,079,543.79
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	47,517,139.55	107,079,543.79

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：南方恒元保本混合型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,296,484,244.14	100,424,891.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-47,517,139.55	47,517,139.55
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)	-512,573,244.17	-17,207,184.66
其中：1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款	-512,573,244.17	-17,207,184.66
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)	-	-22,807,663.69
五、期末所有者权益(基金净值)	2,783,910,999.97	107,927,183.06

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,895,100,140.75	10,216,770.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	105,941,574.01	105,941,574.01
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)	-598,615,896.61	-15,733,452.99
其中：1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款	-598,615,896.61	-15,733,452.99
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)	3,296,484,244.14	100,424,891.86

报表附注为财务报表的重要组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4.1 财务报表附注

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。

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》及其他相关税收法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 以发行方式募集基金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

2) 对基金买卖证券中取得的收入，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。

4) 基金取得股息红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴20%的个人所得税。

5) 以发行方式募集基金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

6.4.4 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

本报告期不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情况

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、基金代机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金托管人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金托管人的股东、基金代销机构

注：1、上述金额按市场公允价值计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费、经手费和适用期间内由券商承担的证券交易风险结算基金后的净额列示。

2、该表附注的服务范围包括收取管理费为本基金提供的相关服务研究成果和市场信息服务等。

6.4.5.1 关联方报酬

6.4.5.1.1 基金管理费

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上期 2012年1月1日至2012年6月30日
当期佣金	74,497.10	72.33%
占当期佣金总量的比例	32,267.64	10.05%

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上期 2012年1月1日至2012年6月30日
当期佣金	74,846.18	6.96%
占当期佣金总量的比例	19,499.55	1.81%

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券费、经手费和适用期间内由券商承担的证券交易风险结算基金后的净额列示。

2、该表附注的服务范围包括收取管理费为本基金提供的相关服务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

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上期 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	20,384,803.38	25,091,739.49
其中：支付销售机构的客户维护费	4,789,000.77	5,919,662.66

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1.3%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 1.3% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上期 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	3,136,123.56	3,860,267.58

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。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 回购 交易

注：无

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

注：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

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上期 2012年1月1日至2012年6月30日
当期利息收入	171,421.95	69,089,070.15
当期利息收入	171,421.95	223,444.24

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 期末 本基金在承销期间内参与关联方承销证券的情况

注：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 因认购新发及增发证券于期末持有的流通受限证券

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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600578	京能热电	2013-4-31	2014-3-31	非公开发行股票流通受限	6.92	6.92	3,170,000	21,936,400.00	21,936,400.00	-

6.4.