

南方金利定期开放债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

应的影响下,CPI同比将逐步回升,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得以再现,但6月份的资金面再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,我们认为利率风险不大,下半年有波段操作的机会,南方金利定期开放基金将以部分仓位参与利率债的波段,信用债将持有南方金利定期开放基金的主要投资品种,但由于目前信用利差较大,不排除当前企业盈利能力下降,信用资质恶化的可能性,并且对于企业信用债的债务对投资的影响也具有一定的不确定性,我们下一阶段将谨慎选择信用状况较好的公司和债券进行投资。

4.6 管理人对于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。会计师事务所在其估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时,应当发表专项审核意见,会计师事务所的估值调整未导致基金资产净值变化的,应履行估值程序复核义务,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的合规合理,建立了负责估值、会计核算和执行的专门机构,组成人员包括督察长、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、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理人参与的相关制度,负责估值工作决策和执行的人员构成中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金合同约定,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;基金合同生效满6个月后,若基金在每季度最后一个交易日收盘后每10份基金份额可分配利润金额高于0.17元(含),则基金应在15个工作日内之内进行收益分配,每份基金份额每次基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,将已在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,可选择现金红利或将现金红利扣除红利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。登记在册基金份额持有人(以下简称“持有人”),则基金应在15个工作日内之内进行收益分配的基金份额持有人,其具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;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;由于本基金A类基金份额收取销售服务费,而另一类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应应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;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,若基金在每季度最后一个交易日收盘后每10份基金份额可分配利润金额高于0.17元(含),则基金应在15个工作日内之内进行收益分配的基金份额持有人,其具体权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50%。本报告期内第一季度未满足分红条件,本基金于2013年4月17日进行了收益分配,各类别份额10份派0.17元;本报告报告期内第二季度未满足分红条件,本基金于2013年7月16日进行了收益分配,各类别份额10份派0.23元。本报告期内2013年1月15日已分配A类基金份额每10份派0.14元,C类基金份额每10份派0.13元,为以往年度收益分配。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况
报告期内,本基金托管人在对南方金利定期开放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
报告期内,南方金利定期开放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金利定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回计价、基金费用开支等方面上,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的规定进行。本报告期内,南方金利定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了2次利润分配,分配金额为49,729,313.61元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见
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金利定期开放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。

6.1 资产负债表
会计主体:南方金利定期开放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	期末 2013年6月30日
银行存款	800,778.57
结算备付金	109,338.40
存出保证金	128,765.75
交易性金融资产	2,119,050,722.20
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	2,119,050,722.20
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	21,426,000.05
应收利息	44,864,234.70
应收股利	-
应收申购款	186,065.78
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	2,216,625,905.43
负债和所有者权益	期末 2013年6月30日
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
应付短期融资款	-
卖出回购金融资产款	482,000,000.00
应付证券清算款	186,065.78
应付赎回款	854,163.25
应付管理费	256,248.97
应付销售服务费	173,779.69
应付交易费用	4,080.71
应交税费	-
应付利息	155,731.36
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	235,610.03
负债合计	483,685,679.79
所有者权益:	
实收基金	1,637,611,527.02
未分配利润	95,148,698.64
所有者权益合计	1,732,760,225.66
负债所有者权益总计	2,216,625,905.43

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额总额1,637,611,527.02份,其中A类基金份额的份额总额为971,196,080.69份,份额净值1.059元;C类基金份额的份额总额为666,415,446.33份,份额净值1.057元。

单位:人民币元	
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	111,581,569.99
1.利息收入	60,726,723.13
其中:存款利息收入	545,259.83
债券利息收入	59,815,463.30
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	37,652,591.48
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	37,652,591.48
资产支持证券投资收益	-
衍生工具投资收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	13,496,255.38
4.其他收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	72,000.00
减:二、费用	20,657,753.76
1.管理人报酬	5,089,297.42
2.托管费	1,526,789.24
3.销售服务费	1,038,564.24
4.交易费用	20,983.33
5.利息支出	12,728,977.68
其中:卖出回购金融资产支出	12,728,977.68
其他费用	253,144.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	90,923,816.23
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	90,923,816.23

单位:人民币元	
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,621,820,800.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	90,923,816.23
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	15,790,726.47
其中:1.基金申购款	21,089,692.86
2.基金赎回款	-5,298,966.39
四、本期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)	-49,729,313.61
五、期末所有者权益(基金净值)	1,637,611,527.02

单位:人民币元	
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,621,823,725.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	14,252,549.86
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	14,252,549.86
其中:1.基金申购款	21,089,692.86
2.基金赎回款	-5,298,966.39
四、本期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)	-49,729,313.61
五、期末所有者权益(基金净值)	1,637,611,527.02

单位:人民币元	
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,621,853,725.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	14,252,549.86
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	14,252,549.86
其中:1.基金申购款	21,089,692.86
2.基金赎回款	-5,298,966.39
四、本期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)	-49,729,313.61
五、期末所有者权益(基金净值)	1,621,853,725.78

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:南方金利定期开放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
一、期初所有者权益(基金净值)	1,621,853,725.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	14,252,549.86
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	14,252,549.86
其中:1.基金申购款	21,089,692.86
2.基金赎回款	-5,298,966.39
四、本期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)	-49,729,313.61
五、期末所有者权益(基金净值)	1,621,853,725.78

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 基金管理人负责人 6.4 报表附注 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一期年度报告相一致的说明 本报告期内采用的会计政策、会计估计与上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 6.4.3 会计政策变更的说明 6.4.2.2 会计估计变更的说明 无。 6.4.2.3 差错更正的说明 无。 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,主要事项列示如下: 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,暂不征收增值税。 ③ 对基金取得的股票股息和利息收入,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。上述所述统一适用20%的应纳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	邓见梁 主管会计工作负责人 邓见梁 会计机构负责人
---	------------------------------------

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
本报告期内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 本报告期与关联方发生关联交易的所有关联方
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、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、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、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。

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
成交金额	318,264,478.16
占当期债券成交总额的比例	26.85%
成交金额	41,440,832.57
占当期债券成交总额的比例	52.35%

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
回购成交金额	10,803,874,000.00
占当期债券回购成交总额的比例	15.45%

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	-5,607.34
占当期佣金总额的比例	86.44%
占期末应付佣金总额的比例	85.06%

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	-529.53
占当期佣金总额的比例	100.00%
占期末应付佣金总额的比例	100.00%

注:上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人于对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券经手费后的净额列示。权证交易不计佣金。
2. 该类市场化协议的服务范围还包括佣金收取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

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0.60%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 0.18% / 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		
	南方金利定期开放债券A	南方金利定期开放债券C	合计
	南方工商银行	1,033,911.50	1,033,911.50
	南方基金	4,552.53	4,552.53
合计	1,038,464.03	1,038,464.03	

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
南方金利定期开放债券A	1,033,911.50
中国工商银行	4,552.33
合计	1,038,464.03
单位:人民币元	
获得销售服务费的各关联方名称	本期 2012年5月17日(基金合同生效日)至2012年6月30日
南方金利定期开放债券A	240,934.02
中国工商银行	1,055.82
合计	241,989.84

注:支付销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日类基金份额的基金资产净值0.30%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。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:
日销售服务费=前一日类基金份额的基金资产净值×0.30%/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	
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
银行间市场交易	债券交易金额
各关联方名称	基金买入
中国工商银行	10,057,519.32

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
银行间市场交易	债券交易金额
各关联方名称	基金买入
中国工商银行	10,057,519.32

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
本基金本报告期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 报告期内除基金管理人之外其他关联方投资本基金的情况
本基金本报告期无其他基金管理人之外其他关联方投资本基金的情况。
6.4.5.5 与关联方保留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
期末余额	800,778.57
当期利息收入	17,712.11
期末余额	8,308,829.73
当期利息收入	169,150.67

6.4.5.6 本基金在承前期内参与关联方承销证券的情况
单位:人民币元
本期
2013年1月1日至2013年6月30日
基金在承前期内买入
数量
(单位:张)
总金额
兴业证券 112156 12中债债 新债分销 140,000 14,000,000.00
6.4.5.7 其他关联方投资事项的说明
本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项
6.4.6 期末基金资产净值及基金份额持有人持有的流通受限证券
6.4.6.1 认购新股及增发证券而于期末未持有的流通受限证券
金额单位:人民币元
受限证券类别:债券
证券代码 证券名称 可流通日期 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
1121 71 普邦 2013年5月14日 新债分销 100.0 100.00 200,000 20,000,000.00 20,000,000.00 -
1121 81 德信 2013年6月12日 新债分销 100.0 100.00 280,000 28,000,000.00 28,000,000.00 -
注:基金可以使用基金名义开设的股票账户,选择网上或网下一种方式进行新股申购。本基金作为一般法人或战略投资者认购新股,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锁定期内不能自由转让;新股作为个人投资者参与网上认购配的新股,从新股发行日至新股上市之日不能自由转让。
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
无。
6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购
注:截至本报告期末2013年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额482,000,000元,于2013年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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	-	-
其中:股票	-	-	-
2	固定收益投资	2,119,050,722.20	95.60
其中:债券	2,119,050,722.20	95.60	
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	30,970,116.97	1.40
6	其他各项资产	66,605,066.28	3.00
7	合计	2,216,625,905.43	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
本基金报告期内未持有股票组合。
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
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期内未发生任何股票买卖。
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
本基金本报告期内未发生任何股票买卖。
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	50,444,000.00	2.91
2	央行票据	-	-
3	金融债	299,530,000.00	17.29
其中:政策性金融债	299,530,000.00	17.29	
4	企业债	1,134,370,722.20	65.47
5	企业短期融资券	370,065,000.00	21.36
6	中期票据	264,641,000.00	15.27
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,119,050,722.20	122.29

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 122188 12国债03 700,000 70,980,000.00 4.10
2 122672 12国债02 600,000 63,900,000.00 3.69
3 124032 12广建投 600,000 61,674,000.00 3.56
4 124022 12招建投 500,000 51,550,000.00 2.98
5 122213 12鹏华债 500,000 51,000,000.00 2.94
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
本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。
7.8 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
本基金本报告期末未持有权证投资。
7.9 投资组合报告附注
7.9.1
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。
7.9.2 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	128,765.75
2	应收证券清算款	21,426,000.05
3	应收股利	-
4	应收利息	44,864,234.70
5	应收申购款	186,065.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,605,066.28

7.9.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

8.1 期末基金持有人户数及持有人结构
份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者持有比例	占总份额比例	持有人数	占总份额比例
南方金利定期开放债券A	9,358	103,782.44	108,820,086.64	11.20%	862,375,994.05	88.80%
南方金利定期开放债券C	6,126	108,784.76	750,630.00	0.11%	665,664,816.33	99.89%
合计	15,484	10761.53	109,570,716.64	6.69%	1,528,040,810.38	93.31%

注:分级基金机构投资者持有份额占总体份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(期末基金份额总额)。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计数。

8.2 期末上市基金前十名持有人南方金定期开放债券A			
序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国农业银行离退休人员福利负债-农行-浦发保险	9,701,944.00	28.05%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	1,534,527.00	4.44%
3	银河证券-光大-银河安心收益2号集合资产管理计划	1,192,700.00	3.45%
4	杨伟斌	1,100,900.00	3.18%
5	张唯	610,364.00	1.76%
6	中信证券-华夏-中信证券贵宾定制2号集合资产管理计划	608,845.00	1.76%
7	杨欣	544,430.00	1.57%
8	袁莹莹	497,692.00	1.44%
9	李慧贞	480,700.00	1.39%
10	湖北省农村信用社联合社企业年金计划-中国工商银行	461,600.00	1.33%
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况			