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

南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)

【2013】半年度报告摘要

§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30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4月25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	南方永利1年定期开放债券(LOF)
基金主代码	160130
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年4月25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	6,535,978,820.58份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013-6-6

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“南方永利”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,在非开放期期间原则上组合久期与初始非开放期适当匹配的基础上,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:一年期定期存款税后收益率+1.2%。
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年4月25日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	33,338,288.68
本期利润	4,800,638.05
加权平均基金份额本期利润	0.0007
本期基金份额净值增长率	0.10%
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	0.0007
期末基金资产净值	6,540,779,458.63
期末基金份额净值	1.001

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。

4.本基金合同在当期2013年4月25日生效,基金合同生效日至本报告期期末基金运作时间未满一年。

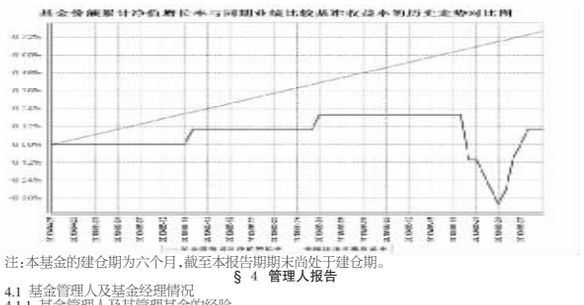
3.2 基金净值表现

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	-0.10%	0.12%	0.35%	0.02%	-0.45%	0.10%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.08%	0.77%	0.01%	-0.67%	0.07%

注:本基金合同在当期2013年4月25日生效。

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:本基金的建仓期为六个月,截至本报告期期末尚处于建仓期。

§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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩亚庆	本基金基金经理、固定收益部执行总监	2013年4月25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、对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离职日期”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、《南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)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,加之出口受汇率高启、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,同时对周期性行业裁退过快过多的情况重视不够。尽管由于人口结构问题、短期失业尚不明显,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。

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月来的上涨,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%。

永利基金成立初期,基于对债市收益估值偏低的看法,我们对债券市场的看法中性偏谨慎,运作初期大量资金以短期逆回购和1个月存款为主,战略上将大量资金运作的时间放在6月底。对于债券投资,由于成立时相对6月底有2个月的时间,过于缓慢的建仓也可能存在问题(一是未计划到6月底资金利率异常高,且持续时间非常长;二是需要一定的底仓累计一定的票息收益),我们采取的策略是在交易所买入期限风险较低、收益率较高的城投债和公司债。从债券投资部分看,到二季度末我们建立了45%左右的仓位,这部分仓位能够提供一定的票息收益并具有融资放大功能。6月20日前后,利用资金利率异常高的市场环境,我们加大力度并运用杠杆投资了银行存款和逆回购。此外,在权益市场方面,由于6月底股市下跌较多,我们认为部分可转债产品已具有中长期价值,并具较好的债性保护,今后能够为基金提供增量收益,因此,基金在6月下旬开始投资转债,考虑永利基金的风险承受力较弱,转债仓位在略高于10%的水平。同时在5月参加了“大华股份”的定增,占比约0.2%。基金已经开始运用一定的杠杆约20%进行投资

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金净值增长率为0.1%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。同时,对于到期资金计划择机滚动投资合适的产品,择机加大杠杆进行有效的投资。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,并将积极把握已建仓转债的卖出机会。新股重启后将有选择的在网上进行新股申购,并审慎参与股票增发。永利基金具有风险承受力低、运作期限固定的特点,我们将力争在一年的封闭期内为投资者带来合理的良好回报。

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信息披露义务,并对基金管理人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,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0.05元(含),则基金须在15个工作日之内进行收益分配,每份基金份额每次基金收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80%;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,登记在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。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及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;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,本报告期内未有收益分配事项。

6.4.4.11分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:①该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;②本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;③本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

6.4.5.3 差错更正的说明

无

6.4.6 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)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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、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

注:关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年4月25日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	13,440,000.00	100.00%

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年4月25日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	361,550,489.24	12.50%

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年4月25日(基金合同生效日)至2013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
华泰证券	2,323,580,000.00	2.51%

6.4.8.1.2 权证交易

注:无。

6.4.8.1.3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4月25日(基金合同生效日)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	-7,599.32	74.89%	-7,599.32	74.89%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年4月25日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,279,473.84
其中,支付销售机构的客户维护费	4,184,275.27

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0.7%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X0.7%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年4月25日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,365,563.98

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.8.4.2 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:无。

6.4.8.5 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4月25日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,510,039.00	1,289,410.51

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。

6.4.8.6 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4月25日(基金合同生效日)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
华泰证券	002236	大华股份	非公开发行	400,000	13,440,000.00

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.10.1.1 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
002236	大华股份	2013年5月29日	2014年5月30日	非公开发行流通受限	33.60	33.98	400,000	13,440,000.00	13,592,000.00	-

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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,420,000,000.00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 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	13,592,000.00	0.17
	其中:股票	13,592,000.00	0.17
2	固定收益投资	3,770,887,845.98	47.33
	其中:债券	3,770,887,845.98	47.33
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	2,612,943,603.16	32.79
	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	1,493,372,831.28	18.74
6	其他各项资产	77,264,552.17	0.97
7	合计	7,968,060,832.59	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,592,000.00	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,592,000.00	0.21

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	002236	大华股份	400,000	13,592,000.00	0.21

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002236	大华股份	13,440,000.00	0.21

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:无。

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	13,440,000.00
卖出股票收入(成交)总额	-

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	49,830,000.00	0.76
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,390,501,609.78	36.55
5	企业短期融资券	418,193,000.00	6.39
6	中期票据	140,750,000.00	2.15
7	可转债	771,613,236.20	11.80
8	其他	-	-
9	合计	3,770,887,845.98	57.65

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110023	民生转债	3,148,780	327,315,681.00	5.00
2	110015	石化转债	1,653,530	165,055,364.60	2.52
3	110020	南山转债	1,428,560	142,727,429.60	2.18
4	122954	09武进债	1,138,800	113,936,940.00	1.74
5	112015	09泛海债	1,058,102	106,868,302.00	1.63

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:无。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

7.10.3 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	87,406.65
2	应收证券清算款	10,246,716.78
3	应收股利	-
4	应收利息	66,930,428.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,264,552.17

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	165,055,364.60	2.52
2	110020	南山转债	142,727,429.60	2.18
3	113001	中行转债	56,129,674.80	0.86
4	110018	国电转债	46,386,218.40	0.71
5	110016	川投转债	33,187,384.00	0.51
6	110022	同仁转债	811,483.80	0.01

7.10.5 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	002236	大华股份	13,592,000.00	0.21	非公开发行

§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
41,366	158,003.65	13,427,285.43	0.21%	6,522,551,535.15	99.79%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	山西忻益铁合金有限公司	2,371,969.00	10.89%
2	贾少君	1,080,032.00	4.96%
3	彭艳霞	1,000,165.00	4.59%
4	吴少珍	1,000,097.00	4.59%
5	李亚晖	997,230.00	4.58%
6	中国第一汽车集团公司企业年金计划-中国工商银行	975,412.00	4.48%
7	董祥	676,036.00	3.10%
8	任子华	600,034.00	2.76%
9	王国庆	600,017.00	2.76%
10	冯日臻	600,017.00	2.76%

8.3 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	994.13	0.00%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额,本基金基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年4月25日)基金份额总额	6,535,978,820.58
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,535,978,820.58

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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

经中国证监会基金部【2013】13号文函复,基金管理人于2013年1月5日发布公告,自2013年1月1日起,高良玉不再担任公司总经理职务,由董事长吴万善代为履行公司总经理职务。

经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1087号文核准,基金管理人于2013年8月22日发布公告,自2013年8月22日起,杨小松转任公司总经理职务,不再担任公司督察长职务。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

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,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

因基金管理人管理的南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金(“开元300ETF”)在集中申购期超过沪深300指数自然权重大比例接受停牌的永泰能源股票换购,然后在建仓期大比例卖出超过沪深300自然权重的部分股票,致使基金资产受到较大损失,2013年4月19日中国证监会向公司下发了《关于对南方基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》(【2013】18号)的行政监管措施决定书,认为基金管理人在开元300ETF投资过程中未能履行谨慎勤勉义务,内部控制方面存在内部控制制度建设薄弱,缺乏ETF募集期股票换购的相关制度规定;合规及风控管理未能覆盖ETF基金投资环节;关于永泰能源的相关决策未能留痕等。鉴于上述情况,按照《证券投资基金管理公司管理办法》第七十五条的规定,中国证监会责令公司进行为期3个月的整改,在整改期间暂停受理和审核公司所有新产品和新业务申请。

基金管理人于2013年4月24日发布了《南方开元沪深300ETF基金持有人补偿公告》,对开元300ETF超比例接受永泰能源股票换购给相关基金份额持有人造成的经济损失进行了补偿, 实际补偿金额为47,996,008.62元。

同时,基金管理人就公司内部管理、合规及风险控制制度建设、ETF募集及投资管理程序方面的问题进行了一一整改,并向中国证监会及其深圳监管局提交了整改报告,目前已完成整改工作、经监管部门现场检查并验收合格。

除上述情况外,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	
华泰证券	1	-	-	-7,599.32	74.89%	-
银河证券	1	-	-	-2,547.37	25.11%	-

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