南方中证50债券指数证券投资基金

【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	南方中证50债券指数(LOF)	
基金主代码	160123	
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2011年5月17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	190,098,361.17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	2011年7月25日	
下属分级基金的基金简称：	南方中证50债券指数(LOF)A	南方中证50债券指数(LOF)C
下属分级基金的交易代码：	160123	160124
报告期末下属分级基金的份额总额	87,008,897.54份	103,089,463.63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50债”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用最优复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况，进行取整和替代优化，以保证对标的指数的有效跟踪。 当预期成份券发生调整时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因市场流动性不足时，或因债券交易特性及交易惯例等因素影响跟踪标的指数效果时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，构建替代组合。由于本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响，本基金组合中个券权重和券种与标的指数成份券和券种间将存在差异。 在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证50债券指数从包括上海证券交易所市场、深圳证券交易所市场以及银行间市场挑选50只流动性强、规模大、质地好的债券组成样本，本基金的整体业绩比较基准可以表述为如下公式：中证50债券指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
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。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

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	南方中证50债券指数(LOF)A	南方中证50债券指数(LOF)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	3,451,595.66	3,947,760.81
本期利润	2,230,012.85	2,404,238.93
加权平均基金份额本期利润	0.0194	0.0172
本期基金份额净值增长率	1.70%	1.52%
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	0.0752	0.0661
期末基金资产净值	93,552,744.99	109,903,772.56
期末基金份额净值	1.0752	1.0661

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

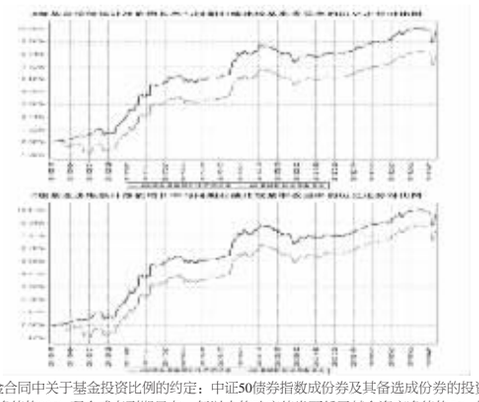
南方中证50债券指数（LOF）A

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	-0.44%	0.20%	-0.48%	0.18%	0.04%	0.02%
过去三个月	0.61%	0.12%	0.62%	0.11%	-0.01%	0.01%
过去六个月	1.70%	0.09%	1.72%	0.08%	-0.02%	0.01%
过去一年	1.61%	0.08%	1.73%	0.07%	-0.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	10.63%	0.09%	8.32%	0.09%	2.31%	0.00%

南方中证50债券指数（LOF）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	-0.47%	0.20%	-0.48%	0.18%	0.01%	0.02%
过去三个月	0.51%	0.12%	0.62%	0.11%	-0.11%	0.01%
过去六个月	1.52%	0.09%	1.72%	0.08%	-0.20%	0.01%
过去一年	1.21%	0.08%	1.73%	0.07%	-0.52%	0.01%
自基金合同生效起至今	9.71%	0.09%	8.32%	0.09%	1.39%	0.00%

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：基金合同中关于基金投资比例的约定：中证50债券指数成份券及其备选成份券的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
刘朝阳	本基金基金经理	2011年5月17日	-	6	女，北京大学光华管理学院金融硕士学位，2007年7月加入南方基金，具有基金从业资格，历任南方基金公司固定收益研究员、债券交易员及固定收益部宏观策略高级研究员。2011年5月至今，任南方50债基金经理；2011年10月至今，任南方现金基金经理；2013年5月至今，任南方中票基金经理。

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、《南方中证50债券指数证券投资基金（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

2013年上半年，市场对经济的预期经历了强复苏、弱复苏到不复苏的转变，成为影响市场情绪的重要因素，而通胀整体温和，不是市场主要关注焦点。政府对经济下行的容忍度提高，更注重控风险，调结构，频频出台规范整顿政策。一季度，在外汇占款大幅增加的情况下，资金面保持充裕；而二季度央行货币政策逐渐转向中性，市场资金面波动加大，特别是在6月央行态度坚决，叠加年中因素，市场情绪一度陷入恐慌，1天到14天回购利率一度飙升至10%以上。上半年利率债整体震荡为主，10年期长期债券体现对经济不好的担忧，收益率略有下行；中短期债券受到6月资金面的冲击，收益率上升；整体收益率曲线呈现平坦化和倒挂的形态。虽然经历了债市监管风暴的短期冲击，上半年信用债整体收益仍好于利率债，期限和评级信用利差仍然处于较低位置。

上半年本基金根据成分券变更和规模的变动进行小幅的调整，有效实现了对指数的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期A级基金净值收益率为1.70%，同期业绩比较基准收益率为1.72%。C级基金净值收益率为1.52%，同期业绩比较基准收益率为1.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，市场普遍降低了对经济增长预期，通胀整体风险不大，但三季度末到四季度初CPI可能会突破3%。货币政策仍将维持中性态度，年内资金面最宽松和最紧张的时期都过去了，资金利率的平均水平将有所上升，抬升短端利率的底部。债券市场收益率受去杠杆的影响，有调整压力，但仍具有一定经济基本面支持。企业盈利较差，并且出现了大量信用债信用评级下调的事件，目前的信用利差较低，并未充分反映风险，我们对信用债更为谨慎。

本基金为被动型指数基金，我们将进一步优化既有的跟踪策略，注重保持组合的流动性，有效跟踪标的指数。

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：本基金A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10%；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记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。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26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中证50债券指数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，南方中证50债券指数证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方中证50债券指数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，南方中证50债券指数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3,110,762.06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中证50债券指数证券投资基金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：南方中证50债券指数证券投资基金

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	1,231,674.25	1,374,982.71
结算备付金	-	-
存出保证金	-	14,705.88
交易性金融资产	219,960,100.00	342,976,000.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	219,960,100.00	342,976,000.00
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	-	-
应收利息	3,951,595.01	5,935,103.68
应收股利	-	-
应收申购款	149,760.49	113,841.60
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	225,293,129.75	350,414,633.87
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	18,809,870.59	14,213,372.89
应付证券清算款	501,107.76	-
应付赎回款	2,107,897.64	2,982,189.42
应付管理人报酬	90,570.17	149,584.60
应付托管费	18,114.05	29,916.95
应付销售服务费	34,267.32	58,082.83
应付交易费用	10,141.26	16,489.56
应交税费	-	-
应付利息	7,797.71	1,534.91
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	256,845.70	420,069.75
负债合计	21,836,612.20	17,871,240.91
所有者权益：		
实收基金	190,098,361.17	312,748,098.76
未分配利润	13,358,156.38	19,795,294.20
所有者权益合计	203,456,517.55	332,543,392.96
负债和所有者权益总计	225,293,129.75	350,414,633.87

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额总额190,098,361.17份，其中A类基金份额的份额总额为87,008,897.54份，份额净值1.0752元；C类基金份额的份额总额为103,089,463.63份，份额净值1.0661元。

6.2 利润表

会计主体：南方中证50债券指数证券投资基金

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	6,350,021.53	23,891,320.60
1.利息收入	5,466,121.13	18,719,217.25
其中：存款利息收入	12,207.07	40,711.35
债券利息收入	5,451,997.39	18,678,505.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,916.67	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	3,634,642.91	17,239,254.13
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,634,642.91	17,239,254.13
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-2,765,104.69	-12,154,272.52
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	14,362.18	87,121.74
减：二、费用	1,715,769.75	5,574,257.29
1.管理人报酬	675,206.14	2,079,074.04
2.托管费	135,041.21	415,814.84
3.销售服务费	258,365.35	867,178.03
4.交易费用	8,150.00	16,697.37
5.利息支出	275,073.22	1,927,165.17
其中：卖出回购金融资产支出	275,073.22	1,927,165.17
6.其他费用	363,933.83	268,327.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,634,251.78	18,317,063.31
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	4,634,251.78	18,317,063.31

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证50债券指数证券投资基金

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)	312,748,098.76	19,795,294.20	332,543,392.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,634,251.78	4,634,251.78
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）	-122,649,737.59	-7,960,627.54	-130,610,365.13
其中：1.基金申购款	154,498,322.34	10,265,230.16	164,763,552.50
2.基金赎回款	-277,148,059.93	-18,225,857.70	-295,373,917.63
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）	-	-3,110,762.06	-3,110,762.06
五、期末所有者权益(基金净值)	190,098,361.17	13,358,156.38	203,456,517.55
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)	1,133,928,792.64	53,036,272.55	1,186,965,065.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,317,063.31	18,317,063.31
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）	-582,647,961.26	-27,143,251.04	-609,791,212.30
其中：1.基金申购款	1,089,478,427.06	47,655,027.50	1,137,133,454.56
2.基金赎回款	-1,672,126,388.32	-74,798,278.54	-1,746,924,666.86
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）	-	-8,004,074.67	-8,004,074.67
五、期末所有者权益(基金净值)	551,280,831.38	36,206,010.15	587,486,841.53

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、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

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 权证交易

无。

6.4.5.1.3 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	675,206.14	2,079,074.04
其中：支付销售机构的客户维护费	206,701.00	447,197.61

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0.50%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 0.50% / 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	135,041.21	415,814.84

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0.1%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 0.1% / 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		
	南方中证50债券指数(LOF)A	南方中证50债券指数(LOF)C	合计
工商银行	-	173,166.92	173,166.92
华泰证券	-	4,295.62	4,295.62
南方基金	-	45,207.72	45,207.72
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		
	南方中证50债券指数(LOF)A	南方中证50债券指数(LOF)C	合计
工商银行	-	470,106.30	470,106.30
华泰证券	-	9,404.88	9,404.88
南方基金	-	272,579.56	272,579.56
兴业证券	-	297.36	297.36
合计	-	752,388.10	752,388.10

注：支付销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.35%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C类基金份额基金资产净值 X 0.35% / 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日					
	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	-	42,054,270.69	-	-	-	-
	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	-	92,895,413.83	-	-	-	-

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	1,231,674.25	8,670.56	1,572,833.30	33,496.46

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

无。

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18,809,870.59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
120301	12进出01	2013年7月1日	99.53	198,000	19,706,940.00
合计				198,000	19,706,940.00

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止，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无余额。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	219,960,100.00	97.63
	其中：债券	219,960,100.00	97.63
	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	1,231,674.25	0.55
6	其他各项资产	4,101,355.50	1.82
7	合计	225,293,129.75	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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	99,677,100.00	48.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,160,000.00	39.40
	其中：政策性金融债	80,160,000.00	39.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,123,000.00	19.72
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	219,960,100.00	108.11

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	1182163	11铁道MTN1	200,000	20,204,000.00	9.93
2	110258	11国开58	200,000	20,148,000.00	9.90
3	120301	12进出01	200,000	19,906,000.00	9.78
4	110411	11农发11	100,000	10,245,000.00	5.04
5	110216	11国开16	100,000	10,089,000.00	4.96

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.6

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.7

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.8 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,951,595.01
5	应收申购款	149,760.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,101,355.50

7.9.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.9.10 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§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

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		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
南方中证50债券指数(LOF)A	5,444	15,982.53	310,773.30	0.36%	86,698,124.24	99.64%
南方中证50债券指数(LOF)C	4,135	24,930.95	10,917,813.06	10.59%	92,171,650.57	89.41%
合计	9,579	19,845.32	11,228,586.36	5.91%	178,869,774.81	94.09%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分