南方广利回报债券型证券投资基金

【2014】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:2014年8月26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2014年8月22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2014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

基金名称	南方广利回报债券型证券投资基金	
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	854,896,823.18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	589,390,598.31份	265,506,224.87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
注册地址		深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		吴万善	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	6,305,612.91	3,762,864.64
本期利润	28,306,416.59	15,266,106.18
加权平均基金份额本期利润	0.0718	0.0636
本期加权平均净值利润率	6.63%	5.96%
本期基金份额净值增长率	6.08%	5.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配利润	36,728,219.18	12,656,594.59
期末可供分配基金份额利润	0.0623	0.0477
期末基金资产净值	658,095,657.56	292,423,711.75
期末基金份额净值	1.117	1.101
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	15.91%	14.29%

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

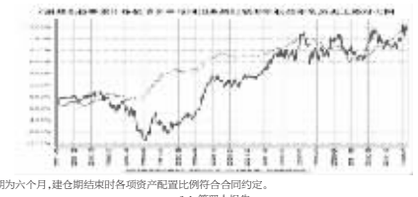
南方广利回报债券A/B

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	2.85%	0.43%	0.79%	0.05%	2.06%	0.38%
过去三个月	4.59%	0.35%	2.94%	0.06%	1.65%	0.29%
过去六个月	6.08%	0.44%	5.68%	0.07%	0.40%	0.37%
过去一年	6.73%	0.43%	2.08%	0.10%	4.65%	0.33%
过去三年	17.67%	0.40%	13.09%	0.09%	4.58%	0.31%
自基金合同生效起至今	15.91%	0.37%	13.39%	0.10%	2.52%	0.27%

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	2.71%	0.42%	0.79%	0.05%	1.92%	0.37%
过去三个月	4.46%	0.35%	2.94%	0.06%	1.52%	0.29%
过去六个月	5.87%	0.43%	5.68%	0.07%	0.19%	0.36%
过去一年	6.32%	0.43%	2.08%	0.10%	4.24%	0.33%
过去三年	16.27%	0.40%	13.09%	0.09%	3.18%	0.31%
自基金合同生效起至今	14.29%	0.37%	13.39%	0.10%	0.90%	0.27%

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

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国"新基金时代"的起始标志。

南方基金总部设在深圳,注册资本1.5亿元人民币。股东结构为: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%);兴业证券股份有限公司(10%)。目前,公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近2,800亿元,旗下管理51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	-	13	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,除首任基金经理外,"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、《南方广利定期开放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4次,其中1次是由于指数型基金按受投资者申赎后被动增减仓位所致,3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

第二季度,地产产业链下滑趋势明显,在一季度经济数据公布后,宏观政策开始转向宽松,并首先表现在准备金率的定向调整方面,尽管央行公开市场利率维持稳定,但债市资金利率受总需求减弱、银行资金配置行为调整等始终处于低位,债市在经济基本面差、货币政策定向降准、资金利率低、各类机构加大债券资产配置等的共同作用下出现较大幅度上涨,10年国债和金融债自4月上旬到6月中下旬,收益率累计下降45和75个BP。从主要债券指数看,中债综合财富数上涨3.28%,中债金债财富指数上涨3.97%。股票市场出现分化,主板指数在低位反复震荡,中小板和创业板指数从5月起逐步走强,转债指数则在二季度持续上涨。从主要权益指数看,沪深300指数上涨0.88%,中证转债指数上涨5.36%,中小板和创业板指数分别上涨4.35%和上涨5.79%。

广利基金第二季度在债券投资中基本以信用债持仓为主,在季度初增加了部分信用债,获取了债市上涨收益,季末降低了部分仓位。在股票和可转债上积极操作,在5月下旬债市快速上涨后,较大比例增加了转债投资,股票投资在成长和周期上更侧重成长风格。

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6.08%,同期业绩比较基准收益率为5.68%。B级基金净值收益率为5.87%,同期业绩比较基准收益率为5.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为二季度以来的经济刺激会在信贷、货币以及部分宏观数据上得到体现,但经济增长仍处于以基建投资对冲房地产投资下滑的阶段,定向调整难以有效刺激经济总需求,经济在三四季度存在反复的可能性。我们判断经济的阶段启稳、三季度债券供应较大等会阶段性不利于债券市场,但经济复苏的动力不强,目前债市的收益水平处于历史较高水平,债市调整的空间也有限,我们对三季度债券市场的看法较中性,投资将仍以信用债为主。宏观数据的阶段性回暖和后续可能出现的反复,会加大股票市场的波动,股市在第三季度难以有非常好的表现,广利基金已在三季度初对转债进行了较大比例的减仓以观察市场,并等待重新进入转债市场的机会。从股票方面看,在经济仍处于转型期,宏观趋势偏弱、股市缺少增量资金的背景下,新型产业和主题投资的机会可能更为突出,是今后研究和投资的重点。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,为投资者累积正回报。

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,组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。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)的时间不得超过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,本报告期本基金未有收益分配事项。

§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,完全履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未进行利润分配。

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2014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:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	22,242,486.04	30,379,340.67
结算备付金	38,571,367.18	18,692,134.63
存出保证金	213,715.84	414,904.13
交易性金融资产	1,621,387,689.72	960,108,517.09
其中:股票投资	183,192,910.53	46,275,843.38
基金投资	–	–
债券投资	1,438,194,779.19	913,832,673.71
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	27,840,524.69	–
应收利息	24,513,424.25	17,577,228.01
应收股利	–	–
应收申购款	438,217.59	233,193.28
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	1,735,207,425.31	1,027,405,317.81
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	754,298,953.45	305,129,144.80
应付证券清算款	24,621,624.77	26,148,707.29
应付赎回款	4,619,491.41	4,075,825.65
应付管理人报酬	435,491.67	403,085.79
应付托管费	133,997.42	124,026.40
应付销售服务费	85,318.51	104,066.73
应付交易费用	186,997.01	324,701.25
应交税费	–	–
应付利息	106,772.20	113,706.45
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	199,409.56	183,978.71
负债合计	784,688,056.00	336,607,243.07
所有者权益:		
实收基金	854,896,823.18	659,598,912.16
未分配利润	95,622,546.13	31,199,162.58
所有者权益合计	950,519,369.31	690,798,074.74
负债和所有者权益总计	1,735,207,425.31	1,027,405,317.81

注:告截止日2014年6月30日,基金份额总额854,896,823.18份,其中A/B类基金份额的份额总额为589,390,598.31份,份额净值1.117元;C类基金份额的份额总额为265,506,224.87份,份额净值1.101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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	57,579,653.91	53,207,502.25
1.利息收入	26,832,342.65	44,610,230.87
其中:存款利息收入	309,951.16	469,428.70
债券利息收入	26,522,391.49	44,140,802.17
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)	-2,831,606.09	61,606,021.55
其中:股票投资收益	-5,279,518.79	34,894,418.48
基金投资收益	–	–
债券投资收益	1,000,030.35	24,798,454.21
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	1,447,882.35	1,913,148.86
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	33,504,045.22	-53,379,185.17
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	74,872.13	370,435.00
减:二、费用	14,007,131.14	22,189,149.98
1.管理人报酬	2,201,500.44	4,734,608.47
2.托管费	677,384.76	1,456,802.64
3.销售服务费	508,762.36	1,313,383.36
4.交易费用	858,834.20	1,879,714.48
5.利息支出	9,543,077.12	12,583,130.86
其中:卖出回购金融资产支出	9,543,077.12	12,583,130.86
6.其他费用	217,572.26	221,510.17
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	43,572,522.77	31,018,352.27
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	43,572,522.77	31,018,352.27

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	659,598,912.16	31,199,162.58	690,798,074.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	43,572,522.77	43,572,522.77
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)	195,297,911.02	20,850,860.78	216,148,771.80
其中:1.基金申购款	444,504,364.69	40,207,497.69	484,711,862.38
2.基金赎回款	-249,206,453.67	-19,356,636.91	-268,563,090.58
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)	854,896,823.18	95,622,546.13	950,519,369.31
项目	上年度可比期间 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

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 邓见爱 邓见爱

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 会计政策和会计估计

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 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	134,481,520.18	21.88%	–	–

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	33,178,014.85	4.15%	–	–

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1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	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	303,000,000.00	0.71%	–	–

6.4.5.1.2 权证交易

注: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 2014年1月1日至2014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	117,676.11	21.68%	–	–
关联方名称	上年度可比期间 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	–	–	–	–

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,201,500.44	4,734,608.47
其中:支付销售机构的客户维护费	613,742.74	1,106,571.38

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	677,384.76	1,456,802.64

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

项目	本期 2014年1月1日至2014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	–	71,766.89	71,766.89
中国工商银行	–	213,131.25	213,131.25
华泰证券	–	6,081.28	6,081.28
兴业证券	–	860.85	860.85
合计	–	291,840.27	291,840.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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
–	–	–	–	–	–	–
	上年度可比期间 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	–	–	–	–	–

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

注: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

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

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	22,242,486.04	41,512.01	42,426,977.60	87,251.63

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 2014年1月1日至2014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	110025	国金转债	网下配售	22,670	2,267,000.00
上年度可比期间 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

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.6 期末(2014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

6.4.12.1.1 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
600703	三安光电	2014年1月30日	2015年1月28日	非公开发行流通受限	21.80	22.46	164,000	3,575,200.00	3,683,440.00	–
603328	依顿电子	2014年6月23日	2014年7月1日	新股流通受限	15.31	15.31	1,000	15,310.00	15,310.00	–
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	500	6,100.00	6,100.00	–

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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600418	江淮汽车	2014年4月11日	重大事项停牌	10.20	2014年7月11日	11.22	217,800	2,232,902.55	2,221,560.00	–
300369	绿盟科技	2014年6月25日	重大事项停牌	61.27	–	–	35,302	2,085,669.05	2,162,953.54	–
300379	东方通	2014年6月20日	重大事项停牌	62.17	2014年8月15日	67.39	18,912	1,245,853.04	1,175,759.04	–
002589	瑞康医药	2014年6月12日	重大事项停牌	46.10	2014年7月3日	50.71	22,070	1,025,059.56	1,017,427.00	–

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

金额单位:人