南方金利定期开放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

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2014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	南方金利定期开放债券	
场内简称	南方金利	
基金主代码	160128	
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2012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	1,661,587,720.34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	2012-07-16	
下属分级基金的基金简称:	南方金利定期开放债券A	南方金利定期开放债券C
下属分级基金的交易代码:	160128	160129
报告期末下属分级基金的份额总额	987,977,465.42份	673,610,254.92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“南方金利”。

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	三年期定期存款税后收益率。
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

基金级别	南方金利定期开放债券A	南方金利定期开放债券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	20,236,509.82	12,769,940.27
本期利润	82,552,954.54	55,121,158.32
加权平均基金份额本期利润	0.0836	0.0817
本期基金份额净值增长率	8.50%	8.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0507	0.0450
期末基金资产净值	1,046,649,740.76	709,659,787.53
期末基金份额净值	1.059	1.054

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

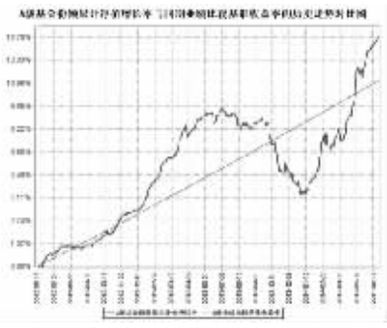
南方金利定期开放债券A

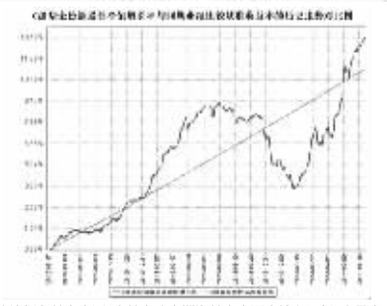
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.24%	0.08%	0.42%	0.01%	0.82%	0.07%
过去三个月	5.06%	0.17%	1.25%	0.01%	3.81%	0.16%
过去六个月	8.50%	0.17%	2.50%	0.01%	6.00%	0.16%
过去一年	4.24%	0.16%	5.11%	0.01%	-0.87%	0.15%
自基金合同生效起至今	13.70%	0.12%	11.15%	0.01%	2.55%	0.11%

南方金利定期开放债券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	1.25%	0.06%	0.42%	0.01%	0.83%	0.05%
过去三个月	5.08%	0.17%	1.25%	0.01%	3.83%	0.16%
过去六个月	8.44%	0.17%	2.50%	0.01%	5.94%	0.16%
过去一年	3.95%	0.16%	5.11%	0.01%	-1.16%	0.15%
自基金合同生效起至今	13.08%	0.12%	11.15%	0.01%	1.93%	0.11%

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:根据相关法律法规和基金合同,本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内。建仓期结束时,本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

§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		
李骏	本基金的基金经理	2012年5月17日	-	7	女,清华大学金融学学士、硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2007年加入南方基金,担任信用债高级分析师,现任固定收益部总监助理。2010年9月至2012年6月,担任南方宝元基金经理;2010年9月至今,担任南方多利基金经理;2012年5月至今,担任南方金利基金经理;2012年12月至今,担任南方安心基金经理;2013年7月至今,担任南方稳利基金经理。
周蕴博	本基金的基金经理助理	2014年3月31日	-	4	南开大学硕士,具有基金从业资格,2010年7月加入南方基金,担任固定收益部债券研究员;2014年3月至今,担任南方金利基金经理助理。

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,“离任日期”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、《南方金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接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

上半年,在一季度各项经济数据均不及预期、房地产压力进一步加剧的背景下,政府逐步加大了稳增长的措施力度,货币政策也由去年下半年的防风险逐步转变为今年二季度的微刺激。1月下旬央行推出中小机构SLF,稳定了市场对资金面的预期;4月份央行下调县域农村商业银行和农村合作银行的存款准备金率,引导信贷资源支持三农;5月份央行等四部委联合出台了整顿银行同业业务的127号文,之后央行采用定向再贷款、并再次采用定向准备金等政策微调工具,防止经济进一步下滑。在经济下滑压力较大、货币政策偏松、银行非标资产收缩等多重因素的作用下,上半年债券市场迎来了一波较大幅度的上涨,中债综合财富指数上涨5.82%,债券市场各品种收益率均有超过100bp的下行。

投资运作上,南方金利定期开放基金在年初配置了较高的债券仓位和久期,以信用债为主,也配置了一定比例的利率债,在上半年的债券牛市中获取了较好的资本利得和票息收益。我们在5月份开始逐步降低组合的久期和杠杆,主要是认为组合已经以高杠杆走过了今年债券牛市的大部分行情,未来宽货币向宽信用过渡的不确定性在增加,我们不宜继续承担过高的利率风险,因此较大幅度的减仓了中长期利率债和信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期南方金利定期开放A级基金净值增长率为8.50%,同期业绩比较基准增长率为2.50%;南方金利定期开放C级基金净值增长率为8.44%,同期业绩比较基准增长率为2.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在外需回暖和稳增长政策发力的双重推动下,中国经济增速开始逐步表现出企稳的迹象,但是房地产投资继续降温仍然是宏观经济运行的最大风险。未来我们认为货币政策仍将维持定向宽松、微刺激的基调,但是6月底银监会调整贷存比计算口径、以及6月份信贷数据及M2增速显著高于预期,标志着政策阶段可能正在由宽货币向宽信用过渡,从而导致债券需求受到一定冲击。但房地产仍然疲弱,而且去年三季度经济基数较高,我们并不能排除短期内数据发生反复导致央行为降低企业融资成本而采取进一步宽松政策的可能,并且当前较为宽松的资金环境并不会发生明显的改变,因此债券市场收益率向上的空间也较为有限。投资运作上,南方金利定期开放基金将仍以信用债为主要投资品种,并注意信用风险的防范,谨慎选择信用状况较好的公司和债券进行投资,利率债的投资将以少量仓位小幅参与波段。

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,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0.1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50%;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;由于本基金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;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,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0.1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50%。本报告期内第一季度末未满足分红条件,未进行收益分配;本报告期内第二季度末满足分红条件,本基金于2014年7月16日进行了收益分配,A类份额每10份派0.26元,C类份额每10份派0.23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

本报告期内,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,南方金利定期开放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金利定期开放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:南方金利定期开放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	2,992,903.00	4,130,785.36
结算备付金	140,212,155.59	136,751,965.34
存出保证金	111,286.05	102,962.74
交易性金融资产	1,916,347,752.50	3,943,018,755.36
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,916,347,752.50	3,943,018,755.36
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	3,996,364.46	-
应收利息	46,546,497.25	66,588,621.72
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,110,206,958.85	4,150,593,090.52
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	346,647,198.47	2,528,505,572.23
应付证券清算款	5,601,389.02	1,331,686.13
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	861,507.34	830,057.66
应付托管费	258,452.23	249,017.30
应付销售服务费	174,064.84	168,467.91
应付交易费用	20,976.52	32,580.52
应交税费	-	-
应付利息	95,712.93	632,569.39
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	238,129.21	197,000.00
负债合计	353,897,430.56	2,531,946,951.14
所有者权益:		
实收基金	1,661,587,720.34	1,661,608,731.02
未分配利润	94,721,807.95	-42,962,591.64
所有者权益合计	1,756,309,528.29	1,618,646,139.38
负债和所有者权益总计	2,110,206,958.85	4,150,593,090.52

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额总额1,661,587,720.34份,其中A类基金份额的份额总额为987,977,465.42份,份额净值1.059元;C类基金份额的份额总额为673,610,254.92份,份额净值1.054元。

6.2 利润表

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: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	181,118,330.62	111,581,569.99
1.利息收入	92,306,826.65	60,360,723.13
其中:存款利息收入	1,447,725.06	545,259.83
债券利息收入	90,859,101.59	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)	-15,856,158.80	37,652,591.48
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-15,856,158.80	37,652,591.48
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	104,667,662.77	13,496,255.38
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	72,000.00
减:二、费用	43,444,217.76	20,657,753.76
1.管理人报酬	4,988,188.23	5,089,297.42
2.托管费	1,496,456.50	1,526,789.24
3.销售服务费	1,009,719.29	1,038,564.32
4.交易费用	35,335.00	20,983.33
5.利息支出	35,648,185.84	12,728,977.68
其中:卖出回购金融资产支出	35,648,185.84	12,728,977.68
6.其他费用	266,332.90	253,141.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	137,674,112.86	90,923,816.23
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	137,674,112.86	90,923,816.23

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: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)	1,661,608,731.02	-42,962,591.64	1,618,646,139.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	137,674,112.86	137,674,112.86
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)	-21,010.68	10,286.73	-10,723.95
其中:1.基金申购款	2,175,366.79	19,719.49	2,195,086.28
2.基金赎回款	-2,196,377.47	-9,432.76	-2,205,810.23
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)	1,661,587,720.34	94,721,807.95	1,756,309,528.29
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)	1,621,820,800.55	53,311,239.77	1,675,132,040.32
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	90,923,816.23
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)	15,790,726.47	642,956.25	16,433,682.72
其中:1.基金申购款	21,089,692.86	900,226.32	21,989,919.18
2.基金赎回款	-5,298,966.39	-257,270.07	-5,556,236.46
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)	-	-49,729,313.61	-49,729,313.61
五、期末所有者权益(基金净值)	1,637,611,527.02	95,148,698.64	1,732,760,225.66

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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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”)	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

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

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	135,648,395.40	11.93%	318,264,478.16	26.85%

6.4.5.1.3 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	8,403,201,000.00	4.93%	10,803,874,000.00	15.45%

6.4.5.1.4 权证交易

无。

6.4.5.1.5 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	-2,344.86	71.89%	-12,048.83	79.10%
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	-5,607.34	86.44%	-8,184.15	85.06%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

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	4,988,188.23	5,089,297.42
其中:支付销售机构的客户维护费	1,555,600.47	2,257,893.85

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0.6%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 0.6% / 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	1,496,456.50	1,526,789.24

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0.18%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 0.18% / 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 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		
	南方金利定期开放债券A	南方金利定期开放债券C	合计
中国工商银行	-	1,005,213.37	1,005,213.37
南方基金	-	4,418.36	4,418.36
合计	-	1,009,631.73	1,009,631.73
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		
	南方金利定期开放债券A	南方金利定期开放债券C	合计
中国工商银行	-	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

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0.30%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C类基金份额基金资产净值 X 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						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额					
	基金买入		基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额
中国工商银行	-		89,060,860.46	-	-	198,460,000.00
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					
	基金买入		基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额
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

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 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	2,992,903.00	47,496.89	800,778.57	17,711.21

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	1480053	14雨田城投债	新债分销	300,000	30,000,000.00	
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日						
		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中順债	新债分销	140,000	14,000,000.00

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

南方金利定期开放债券型证券投资基金于2014年6月25日参加了兴业证券股份有限公司2013年公司债券(第二期)的认购。此次发行的发行人兴业证券股份有限公司为本公司关联方。

根据中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》等有关规定,本公司于2014年6月26日公告本基金获配兴业证券股份有限公司2013年公司债券(第二期)的情况,获配券面总额为3100万元。

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

6.4.9.1.1 受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
122304	13兴业03	2014年6月25日	2014年7月14日	新债分销	100.00	100.00	310,000	31,000,000.00	31,000,000.00	-

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2014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167,147,229.27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
101359008	13杭金投MTN001	2014年7月2日	100.37	30,000	3,011,100.00
101351015	13南山集MTN002	2014年7月2日	101.40	200,000	20,280,000.00
101360012	13乌国资MTN001	2014年7月2日	102.20	200,000	20,440,000.00
101366004	13湖交投MTN001	2014年7月2日	98.53	200,000	19,706,000.00
101373002	13华信资产MTN001	2014年7月2日	101.18	500,000	50,590,000.00
041461039	14华信资产CP001	2014年7月3日	99.85	202,000	20,169,700.00
101462017	14经纺MTN001	2014年7月3日	101.08	400,000	40,432,000.00
合计				1,732,000	174,628,800.00

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014 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179,499,969.20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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,916,347,752.50	90.81
	其中:债券	1,916,347,752.50	90.81
	资产支持证券	-	-