南方现金增利基金

【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

基金简称	南方现金增利货币	
基金主代码	202301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年3月5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	100,824,311,973.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	南方现金增利货币A	南方现金增利货币B
下属分级基金的交易代码:	202301	202302
报告期末下属分级基金的份额总额	68,820,474,221.35份	32,003,837,752.28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“南方现金”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为具有高流动性、低风险和稳定收益的短期金融市场基金,在控制风险的前提下,力争为投资者提供稳定的收益。
投资策略	南方现金增利基金以“保持资产充分流动性,获取稳定收益”为资产配置目标,在战略资产配置上,主要采取利率走势预期与组合久期控制相结合的策略,在战术资产操作上,主要采取滚动投资、关键时期的时机抉择策略,并结合市场环境适时进行回购套利等操作
业绩比较基准	本基金基准收益率=1年期银行定期存款收益率(税后)(至2008年8月26日) 本基金基准收益率=同期7天通知存款利率(税后)(自2008年8月27日起)

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报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告报告备置地点	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	南方现金增利货币A	南方现金增利货币B
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	1,829,676,061.35	1,011,659,817.59
本期利润	1,829,676,061.35	1,011,659,817.59
本期净值收益率	2.6412%	2.7626%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	68,820,474,221.35	32,003,837,752.28
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金收益每月集中支付并按1元面值结转为基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方现金增利货币A

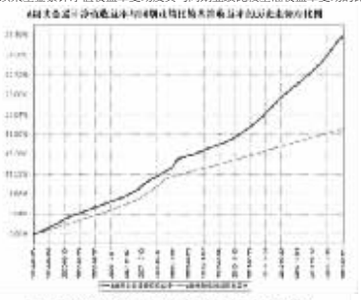
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3692%	0.0005%	0.1126%	0.0000%	0.2566%	0.0005%
过去三个月	1.1921%	0.0009%	0.3418%	0.0000%	0.8503%	0.0009%
过去六个月	2.6412%	0.0018%	0.6810%	0.0000%	1.9602%	0.0018%
过去一年	5.1644%	0.0023%	1.3781%	0.0000%	3.7863%	0.0023%
过去三年	14.2013%	0.0030%	4.3460%	0.0002%	9.8553%	0.0028%
自基金合同生效日起至今	38.4271%	0.0064%	20.3372%	0.0020%	18.0899%	0.0044%

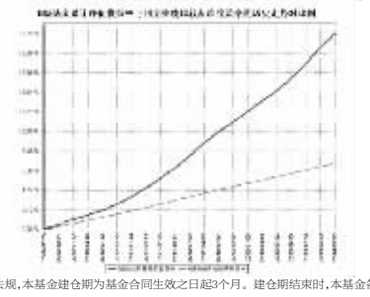
南方现金增利货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.3892%	0.0005%	0.1126%	0.0000%	0.2766%	0.0005%
过去三个月	1.2524%	0.0009%	0.3418%	0.0000%	0.9106%	0.0009%
过去六个月	2.7626%	0.0018%	0.6810%	0.0000%	2.0816%	0.0018%
过去一年	5.4153%	0.0023%	1.3781%	0.0000%	4.0372%	0.0023%
过去三年	15.0218%	0.0030%	4.3460%	0.0002%	10.6758%	0.0028%
自基金合同生效日起至今	21.2426%	0.0051%	7.1921%	0.0002%	14.0505%	0.0049%

注:本基金收益分配为按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:1.根据相关法律法规,本基金建仓期为基金合同生效之日起3个月。建仓期结束时,本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

2.本基金基准收益率=1年期银行定期存款收益率(税后)(至2008年8月26日)

本基金基准收益率=同期7天通知存款利率(税后)(自2008年8月27日起)

§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		
刘朝阳	本基金基金经理	2011年10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、总监助理。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;2014年1月至今,任南方现金通基金经理;2014年6月至今,任南方薪金宝基金经理。
韩亚庆	本基金基金经理、固定收益部执行总监	2008年11月11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,历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;

3.2014年7月25日,增聘夏晨曦为本基金的基金经理。

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、《南方现金增利基金合同》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

2014年上半年,GDP数据和工业增加值在一季度印证了经济增长动能的疲弱,经济增速继续在底部徘徊。进入二季度,尽管房地产投资增速下滑明显,但在政府基建活动和出口活动改善的对冲下,新增固定资产投资完成额出现了显著回升。6月份GDP增速、工业增加值等经济数据均体现了经济逐步回暖。社会融资规模和货币供应量M2也在二季度末出现了快速回升。与去年相比,央行政策层面的变化对资金面产生了积极的影响,特别是二季度公开市场操作持续净投放,通过定向降准和再贷款,向市场提供了充足流动性。上半年资金面整体呈现宽松,直接推动了银行间现券收益率的下行。10年期国债和国开债分别下行了55BP和35BP,1年期金融债和AAA短融分别下行了120BP和160BP,曲线出现陡峭化下行。基金操作方面,由于银行对同业存款的需求出现下降,存款收益率相比债券和逆回购将不再具有明显优势,因此我们增加了对短融和逆回购资产的配置。

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2.6412%,同期业绩比较基准收益率为0.6810%。B级基金净值收益率为2.7626%,同期业绩比较基准收益率为0.6810%。

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,国际经济环境有望继续好转,美联储是否加息将对全球市场造成重大影响。国内经济将继续在弱势中企稳,7月份的汇丰PMI初值数据延续了强劲的回升势头。随着各地房地产政策的逐步放松,房地产销售有望出现企稳回升。通胀方面,下半年CPI整体风险不大,但仍需密切关注猪肉产能收缩可能带来的通胀风险。市场风险偏好上升明显,“宽货币”格局继续向“宽信用”转变。经济基本面整体对债券市场收益率不利,但在政府“降低社会融资成本”的工作目标下,收益率水平短期内仍可能出现一定下行。收益率曲线将进一步陡峭化,但资金面相比上半年不会更宽松。现金增利基金将维持适中久期,保持对短融和银行存款的重点配置,适当配置浮息债和逆回购,在保持基金良好流动性的同时提高静态收益,同时积极灵活把握市场波段操作。我们将密切跟踪经济走势、政策和资金面的情况,保持“稳健有序、积极主动”的管理风格,争取为投资者创造理想的回报。

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

根据本基金合同约定,本基金的收益分配采取“每日分配、按月支付”的方式,即根据每日基金收益公告,以每万份基金单位收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,每月集中以红利再投资方式支付收益。本报告期内应分配收益2,841,335,878.94元,实际分配收益2,841,335,878.94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现金增利基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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,南方现金增利基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方现金增利基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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现金增利基金2014年半年度报告中财务指标、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:南方现金增利基金

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		73,268,997,869.38	42,244,609,828.35
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		38,476,303,934.65	11,591,478,910.23
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		38,301,307,508.00	11,591,478,910.23
资产支持证券投资		174,996,426.65	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		2,534,604,261.90	1,537,343,506.01
应收证券清算款		-	-
应收利息		669,854,766.23	357,165,125.87
应收股利		-	-
应收申购款		642,128,989.43	1,542,022,936.69
递延所得税资产		-	-
其他资产		356,250.00	326,250.00
资产总计		115,592,246,071.59	57,272,946,557.15
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		14,409,500,188.70	4,963,110,345.57
应付证券清算款		61,941,343.97	-
应付赎回款		26,502,429.24	1,637,084.56
应付管理人报酬		37,159,480.12	17,196,657.32
应付托管费		11,260,448.54	5,211,108.26
应付销售服务费		18,107,709.30	9,760,003.58
应付交易费用		556,426.96	204,091.31
应交税费		-	-
应付利息		5,169,299.77	3,475,055.21
应付利润		197,013,687.27	129,538,002.57
递延所得税负债		-	-
其他负债		723,084.09	513,864.23
负债合计		14,767,934,097.96	5,130,646,212.61
所有者权益:			
实收基金		100,824,311,973.63	52,142,300,344.54
未分配利润		-	-
所有者权益合计		100,824,311,973.63	52,142,300,344.54
负债和所有者权益总计		115,592,246,071.59	57,272,946,557.15

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额100,824,311,973.63份,其中A级基金份额总额68,820,474,221.35份,B级基金份额总额32,003,837,752.28份。

6.2 利润表

会计主体:南方现金增利基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资产		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		3,272,497,429.01	1,263,252,433.17
1.利息收入		3,216,388,238.75	1,193,021,350.43
其中:存款利息收入		2,636,793,251.24	820,767,244.20
债券利息收入		472,540,111.97	361,687,201.84
资产支持证券利息收入		838,584.18	-
买入返售金融资产收入		106,216,291.36	10,566,904.39
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		56,104,190.26	70,223,657.07
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		56,104,190.26	70,223,657.07
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)		-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		5,000.00	7,425.67
减:二、费用		431,161,550.07	235,565,392.21
1.管理人报酬		180,041,261.48	89,653,250.60
2.托管费		54,557,958.09	27,167,651.81
3.销售服务费		90,641,054.99	39,120,168.69
4.交易费用		-	-
5.利息支出		105,552,748.48	79,320,322.37
其中:卖出回购金融资产支出		105,552,748.48	79,320,322.37
6.其他费用		368,527.03	303,998.74
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,841,335,878.94	1,027,687,040.96
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,841,335,878.94	1,027,687,040.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方现金增利基金

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)	52,142,300,344.54	-	52,142,300,344.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,841,335,878.94	2,841,335,878.94
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)	48,682,011,629.09	-	48,682,011,629.09
其中:1.基金申购款	292,074,206,072.59	-	292,074,206,072.59
2.基金赎回款	-243,392,194,443.50	-	-243,392,194,443.50
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)	-	-2,841,335,878.94	-2,841,335,878.94
五、期末所有者权益(基金净值)	100,824,311,973.63	-	100,824,311,973.63
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)	48,929,935,462.60	-	48,929,935,462.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,027,687,040.96	1,027,687,040.96
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)	-22,562,358,786.24	-	-22,562,358,786.24
其中:1.基金申购款	118,605,488,134.10	-	118,605,488,134.10
2.基金赎回款	-141,167,846,920.34	-	-141,167,846,920.34
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)	-	-1,027,687,040.96	-1,027,687,040.96
五、期末所有者权益(基金净值)	26,367,576,676.36	-	26,367,576,676.36

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》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,包括买卖债券的差价收入,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。

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、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
广东省南方基金慈善基金会(“南方基金会”)	基金管理人发起的慈善基金会
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

注:无。

债券交易

注:无。

债券回购交易

注:无。

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

注: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 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	180,041,261.48	89,653,250.60
其中:支付销售机构的客户维护费	43,297,647.56	14,698,171.24

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0.33%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 0.33% / 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	54,557,958.09	27,167,651.81

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 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		
	南方现金增利货币A	南方现金增利货币B	合计
中国工商银行	14,915,635.75	93,160.76	15,008,796.51
华泰证券	646,542.99	6,840.91	653,383.90
南方基金	6,292,238.20	1,230,564.52	7,522,802.72
兴业证券	481,866.44	4,733.39	486,599.83
合计	22,336,283.38	1,335,299.58	23,671,582.96
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		
	南方现金增利货币A	南方现金增利货币B	合计
中国工商银行	10,458,179.85	40,500.58	10,498,680.43
华泰证券	523,840.48	3,023.59	526,864.07
南方基金	3,269,376.81	853,968.58	4,123,345.39
兴业证券	362,561.83	3,654.29	366,216.12
合计	14,613,958.97	901,147.04	15,515,106.01

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,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。A级基金份额和B级基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值 X约定年费率 / 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	72,642,731.78	-	999,100,000.00	2,075,913.10	26,998,060,000.00	3,848,606.79
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	172,878,580.82	447,625,981.78	-	-	3,653,650,000.00	788,306.74

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

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	南方现金增利货币A	南方现金增利货币B
基金合同生效日(2004年3月5日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	20,006,535.72
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	20,006,535.72
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.06%

项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	南方现金增利货币A	南方现金增利货币B
基金合同生效日(2004年3月5日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

南方现金增利货币A

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南方基金会	6,499,594.97	0.01%	6,327,311.28	0.02%

南方现金增利货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南方资本管理有限公司	118,544,342.52	0.37%	-	-

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-活期存款	8,997,869.38	121,086.87	8,225,883.16	229,587.96
中国工商银行-定期存款	-	60,665,555.55	-	-

注:本基金的银行活期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

注:无。

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

注:无。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注: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14,409,500,188.70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
090411	09农发11	2014年7月2日	100.07	3,800,000	380,266,000.00
140212	14国开12	2014年7月2日	99.97	1,350,000	134,959,500.00
130322	13进出22	2014年7月2日	100.13	1,100,000	110,143,000.00
090306	09进出06	2014年7月2日	100.12	1,700,000	170,204,000.00
110413	11农发13	2014年7月2日	100.02	13,000,000	1,300,260,000.00
130241	13国开41	2014年7月2日	99.03	1,000,000	99,030,000.00
130243	13国开43	2014年7月2日	99.87	1,000,000	99,870,000.00
041454023	14蒙东CP001	2014年7月3日	100.00	500,000	50,000,000.00
041452007	14联合水泥CP001	2014年7月3日	100.20	500,000	50,100,000.00
071422006	14齐鲁证券CP006	2014年7月3日	99.98	500,000	49,990,000.00
041458012	14浦路桥CP001	2014年7月3日	100.00	500,000	50,000,000.00
110402	11农发02	2014年7月3日	99.60	400,000	39,840,000.00
120227	12国开27	2014年7月3日	97.49	1,400,000	136,486,000.00
130211	13国开11	2014年7月3日	100.20	3,400,000	340,680,000.00
100236	10国开36	2014年7月3日	99.74	4,800,000	478,752,000.00
140213	14国开13	2014年7月3日	99.86	4,100,000	409,426,000.00
130428	13农发28	2014年7月3日	100.13	1,000,000	100,130,000.00
041453008	14路安CP001	2014年7月3日	100.00	500,000	50,000,000.00
041461016	14绍兴城投CP001	2014年7月3日	100.48	600,000	60,288,000.00
041460020	14闽漳龙CP001	2014年7月3日	100.00	1,000,000	100,000,000.00
041461030	14莆国资CP001	2014年7月3日	100.00	300,000	30,000,000.00
041466007	14冀水泥CP002	2014年7月3日	99.92	1,000,000	99,920,000.00
041372008	13绵阳投控CP001	2014年7月3日	100.00	500,000	50,000,000.00
041458023	14中建安装CP001	2014年7月3日	100.00	600,000	60,000,000.00
041466002	14冀水泥CP001	2014年7月3日	100.00	1,000,000	100,000,000.00
071423003	14长城证券CP003	2014年7月3日	99.98	500,000	49,990,000.00
041460034	14川水电CP001	2014年7月3日	100.00	500,000	50,000,000.00
041466009	14粤珠江CP001	2014年7月3日	100.00	400,000	40,000,000.00
140320	14进出20	2014年7月3日	100.09	2,000,000	200,180,000.00
130414	13农发14	2014年7月3日	100.02	700,000	70,014,000.00
130236	13国开36	2014年7月3日	99.98	6,800,000	679,864,000.00
130232	13国开32	2014年7月3日	99.99	600,000	59,994,000.00
011483001	14粤电SCP001	2014年7月3日	99.98	1,000,000	99,980,000.00
130322	13进出22	2014年7月4日	100.13	4,500