# 南方金利定期开放债券型证券投资基金
# 2013 年半年度报告摘要

2013 年 6 月 30 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

送出日期：2013 年 8 月 27 日



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

# §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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

# §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 | |
| 场内基金简称 | 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 | 1,637,611,527.02 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 年 7 月 16 日 | |
| 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 | 971,196,080.69 份 | 666,415,446.33 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 |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.nffund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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(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 | 46,441,777.41 | 30,985,783.44 |
| 本期利润 | 54,397,992.09 | 36,525,824.14 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0564 | 0.0548 |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.50% | 5.40% |
| 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 | 0.0447 | 0.0422 |
| 期末基金资产净值 | 1,028,641,656.64 | 704,118,569.02 |
| 期末基金份额净值 | 1.059 | 1.057 |

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|



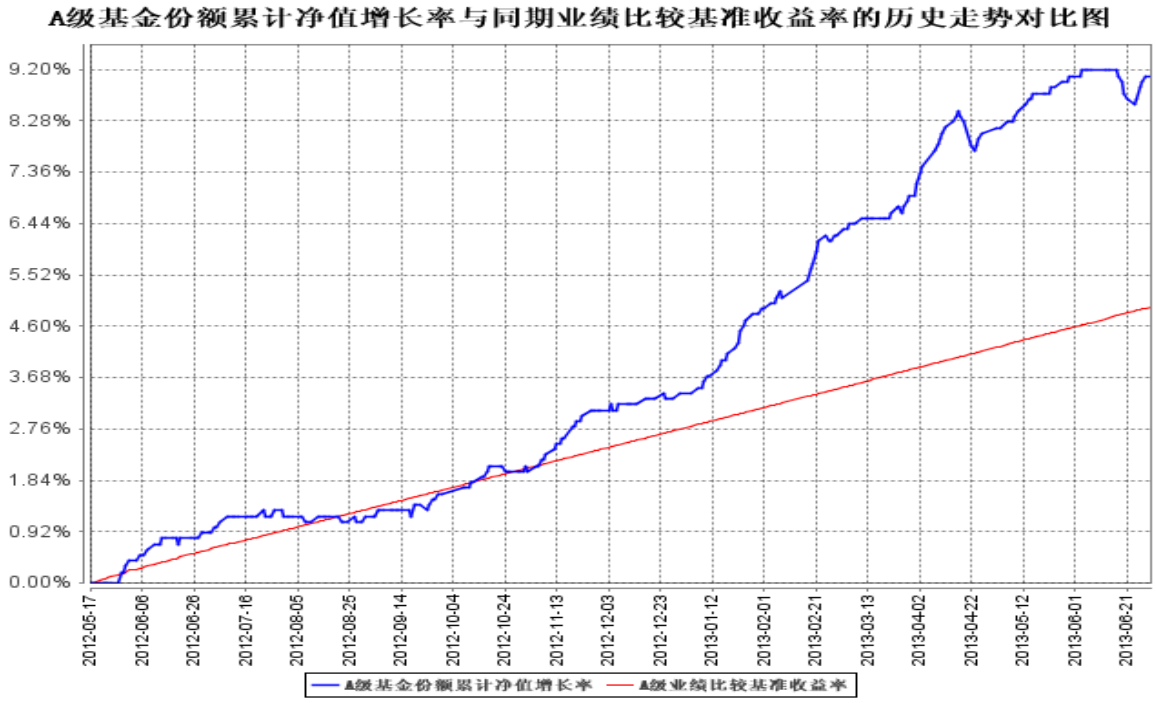
cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.00% | 0.09% | 0.35% | 0.02% | -0.35% | 0.07% |
| 过去三个月 | 2.00% | 0.10% | 1.07% | 0.01% | 0.93% | 0.09% |
| 过去六个月 | 5.50% | 0.09% | 2.13% | 0.02% | 3.37% | 0.07% |
| 过去一年 | 8.11% | 0.08% | 4.34% | 0.01% | 3.77% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.08% | 0.07% | 4.95% | 0.01% | 4.13% | 0.06% |

南方金利定期开放债券 C

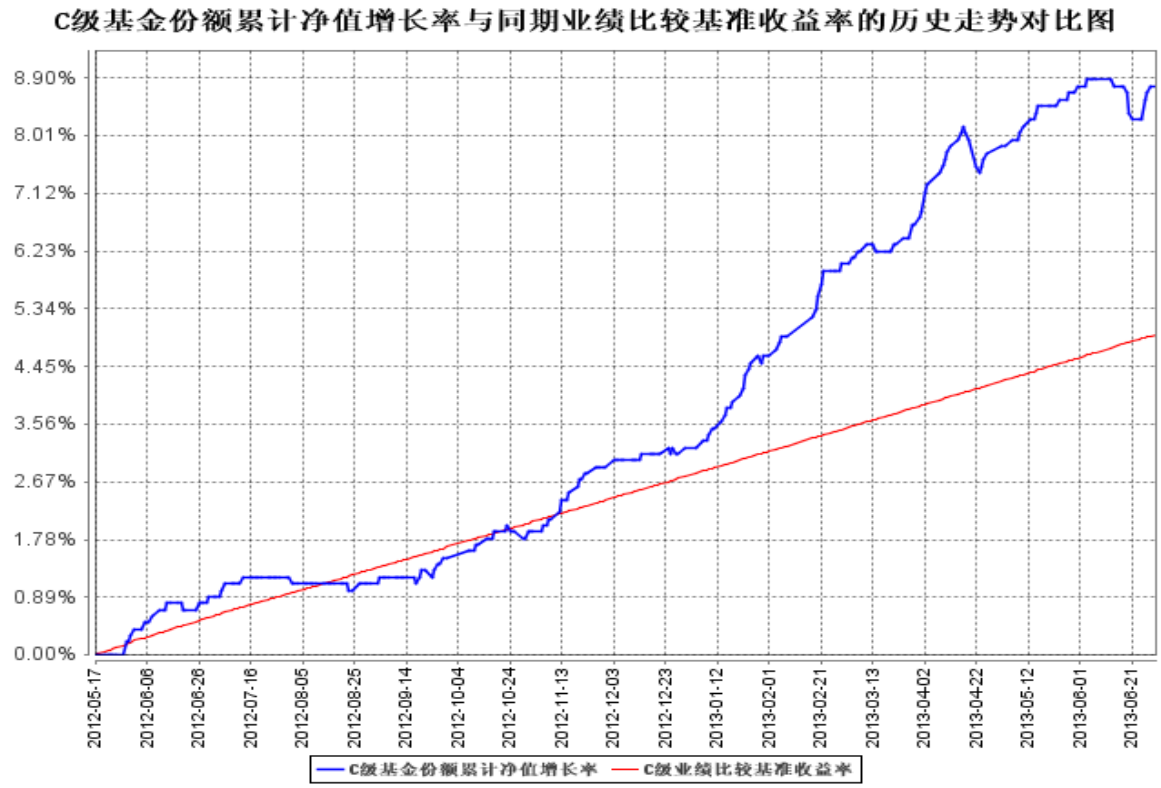
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.00% | 0.11% | 0.35% | 0.02% | -0.35% | 0.09% |
| 过去三个月 | 1.91% | 0.11% | 1.07% | 0.01% | 0.84% | 0.10% |
| 过去六个月 | 5.40% | 0.09% | 2.13% | 0.02% | 3.27% | 0.07% |
| 过去一年 | 7.81% | 0.08% | 4.34% | 0.01% | 3.47% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.78% | 0.07% | 4.95% | 0.01% | 3.83% | 0.06% |

### 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






cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站




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

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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 | | |
| 李璇 | 本基金的基金经理 | 2012 年 5 月 17 日 | - | 6 | 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。 |

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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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

报告期内基金投资策略和运作分析　上半年中国经济的复苏力度连续低于预期，政府对经济下滑的容忍度明显提高，通胀压力不大，一季度外汇占款新增较多，导致整体资金面偏松。在经济数据不及预期和资金面非常充裕的环境下，1-5 月份债券市场收益率以下降为主，其中 4 月中下旬受债市监管风暴影响，中低评级信用债经历了一个短期大幅震荡。6 月份资金面趋紧，导致债券市场收益率全面大幅上行，直至月末最后几天才开始有所恢复。　投资运作上，南方金利定期开放基金上半年的投资仍以信用债为主，并且对信用债进行了一定程度的放大，获取了较好的票息收益和价差收益。随着信用市场的上涨、信用利差的缩窄，以及基于对市场过于宽松的流动性的担心，我们对信用债的结构进行了调整，特别是二季度加快了结构调整的进度，降低了信用债的久期和仓位，以防范可能出现的市场风险。

### 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 5.50%，同期业绩比较基准增长率为 2.13%；南方金利定期开放 C 级基金净值增长率为 5.40% ，同期业绩比较基准增长率为 2.13%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年中国经济疲弱态势仍将延续，微观层面企业的经营状况仍难有明显改善，但经济增速“下限”引导的政府局部刺激以及外需的企稳将对房地产投资和制造业投资的下滑有对冲作用。物价水平仍处于政府目标区间内，通胀压力不明显，但在猪周期缓慢启动和基数效应的影响下，CPI 同比将缓步回升，四季度预计达到 3%左右。央行将继续维持中性的货币政策，并通过逆回购等手段稳定市场对资金面的预期，上半年极度宽松的资金面难以再现，但 6 月份这种资金面极度紧张的局面也不会再发生。基于经济疲弱和通胀压力不大的判断，我们认为利率债风险不大，下半年有波段操作的机会，南方金利定期开放基金将以部分仓位参与利率债的波段；信用债仍然将是南方金利定期开放基金的主要投资品种，但由于目前信用利差较低，不能反映当前企业盈利能力下滑、信用资质变弱的情况，并且审计署全面审计政府债务对城投债的影响也具有一定的不确



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

定性，我们下阶段将谨慎选择信用状况较好的公司和债券进行投资。

## 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，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满足分红条件，本基金于 2013 年 4 月 17 日进行了收益分配，各类份额每 10 份派 0.17 元；本报告期



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

内第二季度末满足分红条件，本基金于 2013 年 7 月 16 日进行了收益分配，各类份额每 10 份派 0.23 元。本报告期内 2013 年 1 月 15 日已分配数（A 类基金份额每 10 份派 0.14 元，C 类基金份额每 10 份派 0.13 元）为以往年度收益分配。

# §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对基金份额持有人进行了 2 次利润分配，分配金额为 49,729,313.61 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金利定期开放债券型证券投资基金 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：南方金利定期开放债券型证券投资基金
报告截止日： 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2013 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 银行存款 | 800,778.57 | 1,677,887.60 |
| 结算备付金 | 30,169,338.40 | 31,905,801.07 |
| 存出保证金 | 128,765.75 | 48,983.32 |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

| | | |
|---|---|---|
| 交易性金融资产 | 2,119,050,722.20 | 2,660,397,126.53 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 2,119,050,722.20 | 2,660,397,126.53 |
| 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 | 21,426,000.05 | 7,157,058.35 |
| 应收利息 | 44,864,234.70 | 36,091,014.59 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 186,065.78 | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,216,625,905.45 | 2,737,277,871.46 |
| **负债和所有者权益** | **本期末<br>2013 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>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 | 482,000,000.00 | 1,060,201,121.49 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 186,065.78 | - |
| 应付管理人报酬 | 854,163.25 | 850,349.52 |
| 应付托管费 | 256,248.97 | 255,104.84 |
| 应付销售服务费 | 173,779.69 | 174,101.57 |
| 应付交易费用 | 4,080.71 | 50,644.51 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 155,731.36 | 352,009.21 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 235,610.03 | 262,500.00 |
| 负债合计 | 483,865,679.79 | 1,062,145,831.14 |
| **所有者权益：** | | |
| 实收基金 | 1,637,611,527.02 | 1,621,820,800.55 |
| 未分配利润 | 95,148,698.64 | 53,311,239.77 |
| 所有者权益合计 | 1,732,760,225.66 | 1,675,132,040.32 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,216,625,905.45 | 2,737,277,871.46 |

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,637,611,527.02 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 971,196,080.69 份，份额净值 1.059 元；C 类基金份额的份额总额为 666,415,446.33 份，份额净值 1.057 元。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、收入** | 111,581,569.99 | 16,224,093.17 |
| 1.利息收入 | 60,360,723.13 | 6,724,263.84 |
| 其中：存款利息收入 | 545,259.83 | 211,839.20 |
| 债券利息收入 | 59,815,463.30 | 3,959,449.22 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 2,552,975.42 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 37,652,591.48 | 1,952,237.81 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 37,652,591.48 | 1,952,237.81 |
| 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） | 13,496,255.38 | 7,547,591.52 |
| 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** | 20,657,753.76 | 1,971,543.31 |
| 1．管理人报酬 | 5,089,297.42 | 1,175,318.14 |
| 2．托管费 | 1,526,789.24 | 352,595.43 |
| 3．销售服务费 | 1,038,564.32 | 242,091.78 |
| 4．交易费用 | 20,983.33 | 18,175.62 |
| 5．利息支出 | 12,728,977.68 | 164,571.80 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 12,728,977.68 | 164,571.80 |
| 6．其他费用 | 253,141.77 | 18,790.54 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | 90,923,816.23 | 14,252,549.86 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | 90,923,816.23 | 14,252,549.86 |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2012 年 5 月 17 日(基金合同生效日)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） | 1,621,853,725.78 | - | 1,621,853,725.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 14,252,549.86 | 14,252,549.86 |
| 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） | | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 1,621,853,725.78 | 14,252,549.86 | 1,636,106,275.64 |

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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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

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

无。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

无。

### 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。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

#### 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、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

| 关联方名称 | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2012年5月17日(基金合同生效日)至<br>2012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 | 318,264,478.16 | 26.85% | 41,440,832.57 | 52.35% |

##### 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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2012年5月17日(基金合同生效日)至<br>2012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 | 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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

| 关联方名称 | 本期<br>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% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2012年5月17日(基金合同生效日)至2012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 | -529.53 | 100.00% | -529.53 | 100.00% |

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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,089,297.42 | 1,175,318.14 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,257,893.85 | 588,852.28 |

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 0.60%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 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2012 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,526,789.24 | 352,595.43 |

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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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 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 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2012 年 5 月 17 日(基金合同生效日)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 | - | 240,934.02 | 240,934.02 |
| 南方基金 | - | 1,055.82 | 1,055.82 |
| 合计 | - | 241,989.84 | 241,989.84 |

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

| 本期 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 | - | 10,057,519.32 | - | - | - | - |

### 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

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

### 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

本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 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<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2012 年 5 月 17 日(基金合同生效日)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 | 800,778.57 | 17,711.21 | 8,308,829.73 | 169,150.67 |

### 6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

| 本期<br>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：张） | 总金额 |
| 兴业证券 | 112156 | 12 中顺债 | 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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项

### 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

金额单位：人民币元

| 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 |
| 112172 | 13 普邦债 | 2013 年 5 月 14 日 | 2013 年 7 月 12 日 | 新债分销 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |
| 112180 | 12 奥飞债 | 2013 年 6 月 14 日 | 2013 年 7 月 23 日 | 新债分销 | 100.00 | 100.00 | 280,000 | 28,000,000.00 | 28,000,000.00 | - |

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。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

### 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

无。

### 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，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 482,000,000 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 | 2,119,050,722.20 | 95.60 |
| | 其中：债券 | 2,119,050,722.20 | 95.60 |
| | 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 | 30,970,116.97 | 1.40 |
| 6 | 其他各项资产 | 66,605,066.28 | 3.00 |
| 7 | 合计 | 2,216,625,905.45 | 100.00 |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有股票组合。

### 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。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 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。

## 7.5 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 | 50,444,000.00 | 2.91 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 299,530,000.00 | 17.29 |
| | 其中：政策性金融债 | 299,530,000.00 | 17.29 |
| 4 | 企业债券 | 1,134,370,722.20 | 65.47 |
| 5 | 企业短期融资券 | 370,065,000.00 | 21.36 |
| 6 | 中期票据 | 264,641,000.00 | 15.27 |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 2,119,050,722.20 | 122.29 |

## 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 | 122188 | 12 华新 03 | 700,000 | 70,980,000.00 | 4.10 |
| 2 | 122672 | 12 西城投 | 600,000 | 63,900,000.00 | 3.69 |
| 3 | 124032 | 12 宜建投 | 600,000 | 61,674,000.00 | 3.56 |
| 4 | 124022 | 12 韶金叶 | 500,000 | 51,550,000.00 | 2.98 |
| 5 | 122213 | 12 松建化 | 500,000 | 51,000,000.00 | 2.94 |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券投资。

## 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

本基金报告期末未持有权证投资。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1

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。

### 7.9.2 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 | 128,765.75 |
| 2 | 应收证券清算款 | 21,426,000.05 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 44,864,234.70 |
| 5 | 应收申购款 | 186,065.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 66,605,066.28 |

### 7.9.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

# §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 |
| 南方金利定期开放债券 A | 9,358 | 103,782.44 | 108,820,086.64 | 11.20% | 862,375,994.05 | 88.80% |
| 南方金利定期开放债券 C | 6,126 | 108,784.76 | 750,630.00 | 0.11% | 665,664,816.33 | 99.89% |
| 合计 | 15,484 | 105761.53 | 109,570,716.64 | 6.69% | 1,528,040,810.38 | 93.31% |

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，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

**南方金利定期开放债券 A**

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 中国农业银行离退休人员福利负债－农行 | 9,701,944.00 | 28.05% |
| 2 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品 | 1,534,527.00 | 4.44% |
| 3 | 银河证券－光大－银河安心收益 2 号集合资产管理计划 | 1,192,700.00 | 3.45% |
| 4 | 杨伟斌 | 1,100,900.00 | 3.18% |
| 5 | 张唯 | 610,364.00 | 1.76% |
| 6 | 中信证券－华夏－中信证券贵宾定制 2 号集合资产管理计划 | 608,845.00 | 1.76% |
| 7 | 杨歆 | 544,430.00 | 1.57% |
| 8 | 袁莹莹 | 497,692.00 | 1.44% |
| 9 | 李慧贞 | 480,700.00 | 1.39% |
| 10 | 湖北省农村信用社联合社企业年金计划－中国工商银行 | 461,600.00 | 1.33% |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 南方金利定期开放债券 A | 3,944,151.14 | 0.41% |
| | 南方金利定期开放债券 C | 1,371,505.14 | 0.21% |
| | 合计 | 5,315,656.28 | 0.32% |

注：1.分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2. 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金基础份额的数量区间为 100 万份以上，本基金基金经理持有本基金基础份额的数量区间为 0 万份至 10 万份（含）。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 南方金利定期开放债券 A | 南方金利定期开放债券 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2012 年 5 月 17 日）基金份额总额 | 953,646,123.12 | 668,207,602.66 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 957,301,094.17 | 664,519,706.38 |
| 本报告期基金总申购份额 | 13,894,986.52 | 7,194,706.34 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | 5,298,966.39 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 971,196,080.69 | 666,415,446.33 |

注：截至报告日,本基金尚未开放申赎，本期份额变动为 C 类基金和 A 类基金的份额转换以及红利再投资。

# §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

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；由鲍文革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。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 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 | - | - | -5,607.34 | 86.44% | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | -879.9 | 13.56% | - |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 318,264,478.16 | 26.85% | 10,803,874,000.00 | 15.45% | - | - |
| 银河证券 | 867,032,592.82 | 73.15% | 59,111,700,000.00 | 84.55% | - | - |

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

a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

b、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；

c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

d、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交易单元：

a、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；

b、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；

c、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便利、提供的资讯是否充足全面。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站