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

## §1 重要提示及目录

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2012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2012年01月01日起至06月30日止。

## §2 基金简介

2.1 25322571900						
基金简称	南方中证50债券指数(LOF)	南方中证50债券指数(LOF)				
基金主代码	160123	160123				
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)	上市契约型开放式(LOF)				
基金合同生效日	2011年5月17日	2011年5月17日				
基金管理人	南方基金管理有限公司	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	中国工商银行股份有限公司				
报告期末基金份额总额	551,280,831.38份	551,280,831.38份				
基金合同存续期	不定期	不定期				
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	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	274,941,623.96份	276,339,207.42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"

21 基金基本情况

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	本基金分減动式指數基金、采用最优复制法、主要以标的指数的成份季均成为基础。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储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。 当短期级份券发生现整计,或比截金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果实标的指数的效果时,或其他原因导致无法有效复制和服器除的指数时,基金管理人服务证的服务的影响,基本管理人是一个企业,或因信息,市场流动性、企业企业,或因信息。由于本基金资产规模、日常申购赎回税品,市场流处性、债券交易特性及全局限例等因素的影响,本基金资产规模、日常申购赎回种与标的指数或份参和参申间将存在意导。在正常市场情况下,为本基金的产值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的形成任何。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和服踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施准免跟踪偏离度,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、质地纤的债券组成样本、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x95%+银行活期存款利率(税后)x5%。				
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 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 指数以及标的指数所代表的债券市场相级的风险收益特征。					
2.3 基金管理	人和基金托管人				
TI	D + A M 700 I + A M 70 I				

## 南方基金管理有限公 中国工商银行股份有限公

		姓名	鲍文革	赵会军		
	信息披露负责人 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		
ſ	传真		0755-82763889 010-66105798			
	2.4 信息披露方式					

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

基金年度报告备置地点

		金额単位:人民市
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(2012年1月1日 - 2012年6月30 日)	报告期(2012年1月1日 - 2012年6 月30日)
本期已实现收益	12,509,192.27	17,962,143.56
本期利润	8,810,144.19	9,506,919.12
加权平均基金份额本期利润	0.0278	0.0206
本期基金份额净值增长率	2.85%	2.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012	2年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0456	0.0408
期末基金资产净值	293,668,879.23	293,817,962.30
期末基金份额净值	1.0681	1.0633
注.1 本期口守和收米担	主个末期到自防 ,	(不今八分价值亦到收兴 知)

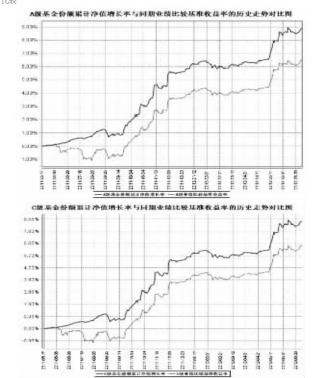
关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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,计人费用后实际收益水平要低于 所列数字。

## 3.2 基金净值表现

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	0.35%	0.10%	0.26%	0.09%	0.09%	0.01%
过去三个月	2.37%	0.11%	2.10%	0.10%	0.27%	0.01%
过去六个月	2.85%	0.09%	2.51%	0.09%	0.34%	0.00%
过去一年	8.45%	0.11%	6.73%	0.11%	1.72%	0.00%
自基金合同 生效起至今	8.88%	0.10%	6.48%	0.11%	2.40%	-0.01%
南方中证:	50债券指数 (LC	F)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	0.33%	0.09%	0.26%	0.09%	0.07%	0.00%
过去三个月	2.28%	0.11%	2.10%	0.10%	0.18%	0.01%
过去六个月	2.65%	0.09%	2.51%	0.09%	0.14%	0.00%
过去ハイカ	8.01%	0.11%	6.73%	0.11%	1.28%	0.00%
过去一年						



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。

4.1 基金管理人及基金经理情况

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 僕 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,公司管理资产规模近2,000亿元,旗下管理32只开放式基金,2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。

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	4- PIR	
刘朝阳	本基金基金 经理	2011年5月17日	-	4	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,具有基金从则 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研究 高级研究员。2011年5月至今,任南方5 债基金经理,2011年10月至今,任南方多

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

# 南方中证50债券指数证券投资基金

# 2012 半年度 报告摘要

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,为基金特有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金特有人利益。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。

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14次,

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 2012年上半年,海外欧债危机动荡,全球复苏较缓,国内经济和通胀继续下降,因此整体投资环境对债券市场仍较有利。利率债收益率整体小幅下降,给投资者带来了稳定的正收益。特别是海龙事件的

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望后市,通胀三季度见底后缓慢上升,经济长期增长动力不足。货币政策仍有放松空间,特别是 外汇占款增量显著收缩后,准备金率下调空间更大。整体宏观经济和货币政策环境对债市仍有一定保

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

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

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 继金合同》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。

企额单位:人民币元 份派0.10元,C类每10份派0.10元。

2012年上半年,本基金托管人在对南方中证50债券指数证券投资基金 (LOF)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

中证50债券指数证券投资基金 LOF 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(LOF)对基金份额持有人进行了 -次利润分配,分配金额为8,004,074.67元。

2012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)

正50债券指数证券投资基金 报告截止日: 2

资产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
笠产:		
银行存款	1,572,833.30	698,169.0
吉算备付金	_	455,038.3
字出保证金	31,372.55	16,666.6
2.易性金融资产	668,314,000.00	1,281,827,500.0
其中:股票投资	_	
<b>基金投资</b>	-	
责券投资	668,314,000.00	1,281,827,500.0
资产支持证券投资	-	
行生金融资产	-	
天人返售金融资产	-	
立收证券清算款	-	
立收利息	12,360,867.28	23,373,180.9
立收股利	_	
立收申购款	511,539.29	2,673,648.4
<b>递延</b> 所得税资产	_	
其他资产	_	
<b>资产总计</b>	682,790,612.42	1,309,044,203.4
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负债:		
豆期借款	_	
足易性金融负债	_	
行生金融负债	_	
<b></b> 供出回购金融资产款	91,999,754.00	118,533,622.2
立付证券清算款	_	
立付赎回款	2,535,151.06	2,314,128.8
立付管理人报酬	253,719.84	508,748.3
立付托管费	50,743.96	101,749.6
立付销售服务费	90,547.32	223,697.9
立付交易费用	21,529.10	28,175.8
立交税费	_	
立付利息	18,362.36	36,133.5
立付利润	_	
<b>並所得税负债</b>	_	
其他负债	333,963.25	332,881.7
负债合计	95,303,770.89	122,079,138.2
	25,565,776.69	122,077,130.2
所有者权益:	551 280 831 38	1 133 928 702 6
所有者权益: E收基金	551,280,831.38 36,206,010.15	1,133,928,792.6
以同合り 所有者权益: 実收基金 未分配利润 所有者权益合计	551,280,831.38 36,206,010.15 587,486,841.53	1,133,928,792.6 53,036,272.5 1,186,965,065.1

会计主体:南方中证50债券指数证券投资基金 本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

件IX日列:2012年1/11日±2012年0	7130日	单位:人民币:
项 目	本期 2012年1月1日至2012年6月30 日	上年度可比期间 2011年5月17日至2011年6月30日
一、收入	23,891,320.60	13,702,787.99
1.利息收入	18,719,217.25	12,103,897.63
其中:存款利息收入	40,711.35	280,866.46
债券利息收入	18,678,505.90	1,798,525.18
资产支持证券利息收入	-	_
买人返售金融资产收入	-	10,024,505.99
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	17,239,254.13	771,707.58
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	17,239,254.13	771,707.58
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)	-12,154,272.52	826,564.13
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	87,121.74	618.65
减:二、费用	5,574,257.29	3,102,198.37
1.管理人报酬	2,079,074.04	1,706,081.71
2.托管费	415,814.84	341,216.34
3.销售服务费	867,178.03	802,655.23
4.交易费用	16,697.37	6,325.00
5.利息支出	1,927,165.17	123,426.35
其中:卖出回购金融资产支出	1,927,165.17	123,426.35
6.其他费用	268,327.84	122,493.74
三、利润总额 (亏损总额以"-"号填列)	18,317,063.31	10,600,589.62
减.所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	18,317,063.31	10,600,589.62

会计主体:南方中证50债券指数证券投资基金

的基金净值变动数 (净值减少以"-

·1.基金申购款

项目

、本期基金份额交易 的基金净值变动数 (净值减少以"-" [列)

中:1.基金申购款

i变动(净值减少) 号填列)

、期末所有者权益(ā 争值)

报表附注为财务报表的

基金管理公司负责人

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

6.4 报表附注

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

南方基金管理有限公司("南方基金公司")

业证券股份有限公司("兴业证券")

6.4.4.1.1 股票交易

债券交易

债券回购交易

6.4.4.1.2 权证交易

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

项目

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 其中12次是由于报告期初指数基金成份股调整,1次是由于接受大额申购使得基金规模增大,配置债券所需,1次是由于社保201组合调整,选择期限与收益匹配较好的债券进行投资的需要。

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

平稳解决刺激了风险偏好,并且年初中低评级信用债的高收益率具有吸引力,因此今年来中低等级信用债表现非常突出,大幅战胜了利率债和高等级信用债。

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2.85%,同期业绩比较基准收益率为2.51%。C级基金净值收益率为2.65%,同期业绩比较基准收益率为2.51%。

护,收益率或区间震荡为主,系统性风险不大。但基于目前收益率水平已处于历史偏低位置,特别是信 用债的信用利差已显著低于历史均值,在历史四分之一分位处,资本利得机会逐渐减少,风险日益突 出。总体来看,我们认为下半年的债券投资策略不官讨断

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本基金于2012年2月17日进行了收益分配,A类每10

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2012年上半年,南方中证50债券指数证券投资基金 **LOF**)的管理人——南方管理有限公司在南方

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(LOF)

6.1 资产负债表

		无。 6.4.4.2 关联方报酬 6.4.4.2.1 基金管理费	单位:人民币元	9A III. 77 1 A 24 S M.	2012年6月30日
单位:人民币元		0.4.4.2.1 经业日建以	上年度末 1年12月31日	本期末 2012年6月30日	jtha
上年度可比期间 2011年5月17日(基金合同生效日)至2011	本期	项目			
年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日		698,169.02	1,572,833.30	
.04 1,706,081.71	2,079,074.04	当期发生的基金应支付的管	455,038.37	-	
, ,		理费	16,666.67	31,372.55	
61 399,586.29	447,197.61	其中:支付销售机构的客户 维护费	1,281,827,500.00	668,314,000.00	
基金资产净值0.50%的年费率计提,逐日累	方基金的管理人报酬按前一日基金	注:支付基金管理人 南	_	-	
	其计算公式为:	计至每月月底,按月支付。其	_	-	
<b></b> 天数。	基金资产净值 X 0.50%/当年天数		1,281,827,500.00	668,314,000.00	

上年度可比期间 2011年5月17日(基金合同生效日)至2011 年6月30日 本期 2012年1月1日至2012年6月30日

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。

0.4.4.2.3 И БЛКЛУ			单位:人民币元			
	本期 2012年1月1日至2012年6月30日					
获得销售服务费的 各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费					
11 / 11/1/ 11/1/	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			
	上年度可比期间 2011年5月17日(基金合同生效日)至2011年6月30日					
获得销售服务费的 各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费					
11 / 11/1/ 11/1/	南方中证50债券指数 (LOF)A	南方中证50债券指数 (LOF)C	合计			
中国工商银行	-	516,058.55	516,058.55			
南方基金	-	128,544.59	128,544.59			
兴业证券	-	8.80	8.80			
华泰证券	-	10,030.01	10,030.01			
华泰联合证券	-	23,722.83	23,722.83			
合计	-	678,364.78	678,364.78			

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。 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 焓回购)交易

0.4.4.5 370400						单位:人民币
		2012年1月1日	本期 至2012年6月	30 ⊟		
银行间市场交易	债券	交易金额	基金注	逆回购	基金	:正回购
的 各关联方名称	基金买人	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	-	-	-	-
		上年度 2011年5月17日	可比期间 至2011年6月	30∃		
银行间市场交易	债券	交易金额	基金注	逆回购	基金	:正回购
的 各关联方名称	基金买人	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	-	10,023,137.10	-	-	-	-

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.4.2 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

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

				単位:人民市π
关联方 名称	本期 2012年1月1日至2		上年度可 2011年5月17日(基金台 6月3	合同生效日)至2011年
	期末余额	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
中国工商银行	1,572,833.30	33,496.46	106,189,294.39	209,384.22

§7 投资组合报告

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.5 期末 2012年6月30日 )本基金持有的流通受限证券 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金額(元)	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	668,314,000.00	97.88
	其中:债券	668,314,000.00	97.88
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金 融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,572,833.30	0.23
6	其他资产	12,903,779.12	1.89
7	승计	682 790 612 42	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元

所有者权益合计

1,186,965,065.19

18,317,063.3

-609,791,212.30

1.137.133.454.56

-1,746,924,666.86

2,826,750,103,2

2,837,350,692.85

-8,004,074.6

2012年1月1日至2012年6月30日

53,036,272.5

18,317,063.3

-27,143,251.04

47.655.027.5

-74,798,278.54

-8,004,074.6

36,206,010.13

10,600,589.62

2011年5月17日至2011年6月30

1,133,928,792.64

-582,647,961.26

1.089.478.427.06

-1,672,126,388.32

551,280,831.38

2,826,750,103,23

2,826,750,103.23

\_\_\_\_\_鲍文革\_\_\_\_ 主管会计工作负责人

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

6431 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

基金管理人、基金销售机构

基金托管人、基金代销机构

基金管理人的股东,基金代销机

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。

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。

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 累计买人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 买人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:
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比 例(%)
1	国家债券	288,522,000.00	49.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	235,973,000.00	40.17
	其中:政策性金融债	235,973,000.00	40.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,622,000.00	6.91
6	中期票据	103,197,000.00	17.57
7	可转债	-	-
0	甘 /h		

金额单位:人民币元 债券名称 数量(张) 公允价值 41,152,000.0

668,314,000.00

12,903,779.12

110410 11次发10 300.000 30.717.000.0 5.23 110007 11附息国债07 300,000 30,426,000.00 5.18 1182222 11中煤MTN1 21,304,000.0 110015 11附息国债15 200.000 21.026.000.00

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

内受到公开谴责、处罚的情形

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。 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元 立收证券清算表 511,539.29

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

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

§8 基金份额持有人信息

8.1 州小	至並 (刀 映) 、	f 有 人 尸 奴 及 行	17 A		1	分额单位:
	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
份额级别			机构投资者		个人投资者	
D 194-94 D1			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	6,778	40,563.83	101,906,801.20	37.06%	173,034,822.76	62.94%
南方中证50 债 券 指 数 (LOF)C	4,330	63,819.68	21,589,583.93	7.81%	254,749,623.49	92.19%
合计	11,108	49,629.17	123,496,385.13	22.40%	427,784,446.25	77.60%

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6数)。 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 南方中证50债券指数 (LOF)A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	冯汉斌	1,513,400.00	14.05%
2	李永华	480,033.00	4.46%
3	赵强	310,362.00	2.88%
4	余淑珍	300,900.00	2.79%
5	胡汝松	296,917.00	2.76%
6	韩录	250,368.00	2.32%
7	徐秀兰	248,057.00	2.30%
8	金永钢	200,000.00	1.86%
9	镇江中凯房地产有限公司	200,000.00	1.86%
10	庄和生	190,000.00	1.76%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的 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 南方中证50债券指数 (LOF)C 0.009 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

2.本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额,本基金基金经理未持有 本基金A类和C类份额。

# §9 开放式基金份额变动

		单位:他			
项目	南方中证50债券指数(LOF) A	南方中证50债券指数 (LOF)C			
基金合同生效日(2011年5月17日)基金份额总额	926,774,736.42	1,899,975,366.81			
本报告期期初基金份额总额	412,326,526.21	721,602,266.43			
本报告期基金总申购份额	199,881,670.40	889,596,756.66			
减:本报告期基金总赎回份额	337,266,572.65	1,334,859,815.67			
本报告期基金拆分变动份额	-	-			
本报告期期末基金份额总额	274,941,623.96	276,339,207.42			
810 重大事件揭示					

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金投资策略未改变

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 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉 本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的证

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

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 交易单5 数量 占当期佣金总量的比例 备注 成交金额

券商名称 华泰证券

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

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务

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 1、公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;

2、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 3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求:

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 选择席位: 1、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; 2.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; 3、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。

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

权证交易 券商名称