南方现金增利基金

2013 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

§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。

§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	26,367,576,676.36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	20,507,976,549.41份	5,859,600,126.95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(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	559,473,644.28	468,213,396.68
本期利润	559,473,644.28	468,213,396.68
本期净值收益率	1.8593%	1.9804%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末基金资产净值	20,507,976,549.41	5,859,600,126.95
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

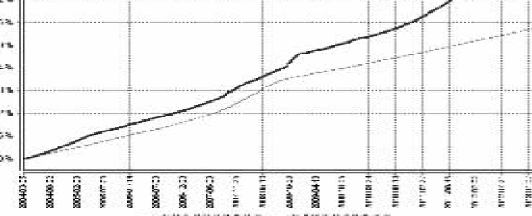
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3080%	0.0037%	0.1126%	0.0000%	0.1954%	0.0037%
过去三个月	0.9185%	0.0027%	0.3418%	0.0000%	0.5767%	0.0027%
过去六个月	1.8593%	0.0024%	0.6810%	0.0000%	1.1783%	0.0024%
过去一年	3.8189%	0.0025%	1.3801%	0.0000%	2.4388%	0.0025%
过去三年	11.9563%	0.0036%	4.3874%	0.0002%	7.5689%	0.0034%
自基金合同生效日起至今	31.6296%	0.0065%	18.7013%	0.0020%	12.9283%	0.0045%

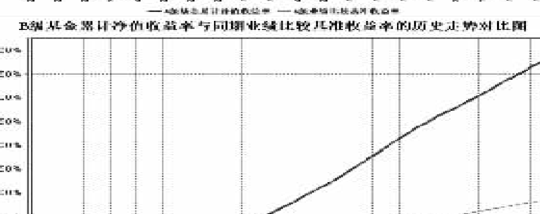
南方现金增利货币B

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	0.3281%	0.0037%	0.1126%	0.0000%	0.2155%	0.0037%
过去三个月	0.9789%	0.0027%	0.3418%	0.0000%	0.6371%	0.0027%
过去六个月	1.9804%	0.0024%	0.6810%	0.0000%	1.2994%	0.0024%
过去一年	4.0673%	0.0025%	1.3801%	0.0000%	2.6872%	0.0025%
过去三年	12.7615%	0.0036%	4.3874%	0.0002%	8.3741%	0.0034%
自基金合同生效日起至今	15.0146%	0.0051%	5.7349%	0.0002%	9.2797%	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

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	-	5	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。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。
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	-	12	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

2013年上半年,市场对经济的预期经历了强复苏、弱复苏到不复苏的转变,成为影响市场情绪的重要因素,而通胀整体温和,不是市场主要关注焦点。政府对经济下行的容忍度提高,更注重控风险,调结构,频频出台规范整顿政策。一季度,在外汇占款大幅增加的情况下,资金面保持充裕;而二季度央行货币政策逐渐转向中性,市场资金面波动加大,特别是在6月央行态度坚决,叠加年中因素,市场情绪一度陷入恐慌,1天到14天回购利率一度飙升至10%以上。中长期债券体现对经济不好的担忧,收益率略有下行;中短期债券受到年中资金面的冲击,收益率上升;整体收益率曲线呈现平坦化和倒挂的形态。货币市场收益率在6月大幅上升,上升幅度和速度均为近几年之最。1年期各评级短融收益率较3月底均上升超过100bp,较年初也上升50bp左右;3个月shibor从3.88%左右的水平一路攀升至5.8%左右。在巨大利差的影响下,货币基金普遍遭受了大量赎回,平均规模较一季度末缩水一半左右。上半年,现金增利在保证基金流动性的情况下,保持了存款和短融的较高仓位,将大量资金集中安排在6月到期,久期配置由中性逐渐趋于防守。

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1.8593%,同期业绩比较基准收益率为0.6810%。B级基金净值收益率为1.9804%,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

展望后市,下半年经济增速回落趋势较为明显,保增长压力加大,通胀整体风险不大。就业问题不大的情况下,政府不会启动过激的政策刺激。在去杠杆、控风险的总体思路不变的情况下,货币政策仍将维持中性态度,年内资金面最宽松和最紧张的时期都过去了。下半年资金利率的平均水平较上半年将会上升,较为显著抬升短端利率的底部。6月底货币市场收益率均具有非常好的配置价值和交易价值,但下半年货币市场仍有波动。因此,现金增利基金将维持适中久期,保持对银行存款和短融的重点配置,适当配置逆回购和浮息债,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

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1,027,687,040.96元,实际分配收益1,027,687,040.96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2013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:2013年6月30日

单位:人民币元

资产		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		10,008,225,883.16	30,709,562,766.67
结算备付金		-	-
存出保证金		-	250,000.00
交易性金融资产		18,553,086,033.84	18,793,777,078.83
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		18,553,086,033.84	18,793,777,078.83
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	3,055,507,663.26
应收证券清算款		382,651,043.56	-
应收利息		335,184,392.43	627,127,064.19
应收股利		-	-
应收申购款		325,553,271.43	22,881,880.62
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	145,000.00
资产总计		29,604,700,624.42	53,209,251,453.57
负债和所有者权益		本期末 2013年6月30日	上年度末 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		3,164,597,297.70	4,158,242,753.37
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,113,334.98	689,419.00
应付管理人报酬		13,049,785.39	13,882,048.13
应付托管费		3,954,480.45	4,206,681.27
应付销售服务费		6,284,098.71	6,192,955.77
应付交易费用		285,260.37	309,767.31
应交税费		-	-
应付利息		1,294,177.00	2,047,393.04
应付利润		45,722,887.17	92,860,306.69
递延所得税负债		-	-
其他负债		822,626.29	884,666.39
负债合计		3,237,123,948.06	4,279,315,990.97
所有者权益:			
实收基金		26,367,576,676.36	48,929,935,462.60
未分配利润		-	-
所有者权益合计		26,367,576,676.36	48,929,935,462.60
负债和所有者权益总计		29,604,700,624.42	53,209,251,453.57

注:报告截止日2013年06月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额26,367,576,676.36份,其中A级基金份额总额20,507,976,549.41份,B级基金份额总额5,859,600,126.95份。

6.2 利润表

会计主体:南方现金增利基金

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		1,263,252,433.17	936,091,353.52
1.利息收入		1,193,021,350.43	891,106,348.20
其中:存款利息收入		820,767,244.20	579,863,121.53
债券利息收入		361,687,201.84	284,367,341.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,566,904.39	26,875,884.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		70,223,657.07	44,944,838.13
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		70,223,657.07	44,944,838.13
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)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		7,425.67	40,167.19
减:二、费用		235,565,392.21	143,339,399.40
1.管理人报酬		89,653,250.60	55,936,772.25
2.托管费		27,167,651.81	16,950,537.05
3.销售服务费		39,120,168.69	24,667,083.91
4.交易费用		-	-
5.利息支出		79,320,322.37	45,434,894.80
其中:卖出回购金融资产支出		79,320,322.37	45,434,894.80
6.其他费用		303,998.74	350,111.39
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,027,687,040.96	792,751,954.12
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,027,687,040.96	792,751,954.12

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:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2012年1月1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)	24,361,918,497.94	-	24,361,918,497.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	792,751,954.12	792,751,954.12
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)	14,074,166,769.60	-	14,074,166,769.60
其中:1.基金申购款	107,420,312,597.35	-	107,420,312,597.35
2.基金赎回款	-93,346,145,827.75	-	-93,346,145,827.75
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)	-	-792,751,954.12	-792,751,954.12
五、期末所有者权益(基金净值)	38,436,085,267.54	-	38,436,085,267.54

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。

(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

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	89,653,250.60	55,936,772.25
其中:支付销售机构的客户维护费	14,698,171.24	9,606,853.80

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,167,651.81	16,950,537.05

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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方现金增利货币A	南方现金增利货币B	合计
中国工商银行	7,980,930.15	32,852.37	8,013,782.52
华泰证券	358,817.44	2,332.63	361,150.07
南方基金	1,664,584.42	580,466.92	2,245,051.34
兴业证券	199,752.98	2,684.25	202,437.23
合计	10,204,084.99	618,336.17	10,822,421.16

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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
中国工商银行	172,878,580.82	447,625,981.78	-	-	3,653,650,000.00	788,306.74
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
华泰联合证券	10,005,301.37	-	-	-	-	-
中国工商银行	206,636,209.29	60,434,696.67	-	-	504,400,000.00	1,468,553.31
兴业证券	100,503,104.68	-	-	-	-	-

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

南方现金增利货币A

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012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	-	-	8,236,775.50	0.03%

南方现金增利货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012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
兴业证券	-	-	50,000,000.00	0.22%

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1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-活期存款	8,225,883.16	229,587.96	37,480,500.22	76,960.63

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(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

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2013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3,164,597,297.70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
090205	09国开05	2013年7月1日	99.93	2,500,000	249,825,000.00
090213	09国开13	2013年7月1日	100.58	2,000,000	201,160,000.00
090306	09进出06	2013年7月1日	100.31	700,000	70,217,000.00
090411	09农发11	2013年7月1日	100.16	600,000	60,096,000.00
100209	10国开09	2013年7月1日	99.75	1,500,000	149,625,000.00
100230	10国开30	2013年7月1日	99.38	1,400,000	139,132,000.00
120233	12国开33	2013年7月1日	98.14	1,500,000	147,210,000.00
120238	12国开38	2013年7月1日	99.95	1,400,000	139,930,000.00
120314	12进出14	2013年7月1日	99.99	300,000	29,997,000.00
120419	12农发19	2013年7月1日	99.99	5,600,000	559,944,000.00
130210	13国开10	2013年7月1日	99.98	1,600,000	159,968,000.00
130211	13国开11	2013年7月1日	100.33	2,100,000	210,693,000.00
130214	13国开14	2013年7月1日	99.89	3,000,000	299,670,000.00
130215	13国开15	2013年7月1日	99.88	3,000,000	299,640,000.00
058031	05中信债1	2013年7月1日	98.98	1,150,000	113,827,000.00
088028	08合肥建投债	2013年7月1日	102.00	1,000,000	102,000,000.00
0882022	08华能集MTN2	2013年7月1日	100.12	500,000	50,060,000.00
0882026	08中铝MTN2	2013年7月1日	100.28	1,000,000	100,280,000.00
0982006	09铁道部MTN1	2013年7月1日	99.30	400,000	39,720,000.00
1082162	10首发MTN1	2013年7月1日	100.11	1,000,000	100,110,000.00
合计				32,250,000	3,223,104,000.00

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	固定收益投资	18,553,086,033.84	62.67
	其中:债券	18,553,086,033.84	62.67
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	10,008,225,883.16	33.81
4	其他各项资产	1,043,388,707.42	3.52
5	合计	29,604,700,624.42	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	9.12	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,164,597,297.70	12.00
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:1、报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

2、在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	122
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	19.74	12.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.10	-
2	30天(含)—60天	12.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.53	-
3	60天(含)—90天	19.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.66	-
4	90天(含)—180天	42.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.80	-
5	180天(含)—397天(含)	16.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.77	12.00

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,338,575,027.16	20.25
	其中:政策性金融债	5,338,575,027.16	20.25
4	企业债券	691,118,923.60	2.62
5	企业短期融资券	12,183,236,220.57	46.21
6	中期票据	340,155,862.51	1.29
7	其他	-	-
8	合计	18,553,086,033.84	70.36
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	3,450,068,326.80	13.08

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	120419	12农发19	6,200,000	619,957,677.50	2.35
2	041261041	12国电集CP004	4,800,000	480,072,355.20	1.82
3	100236	10国开36	4,800,000	477,931,891.93	1.81
4	120318	12进出18	4,300,000	430,105,088.59	1.63
5	011319003	13国电SCP003	3,500,000	349,902,644.53	1.33
6	130211	13国开11	3,400,000	341,138,663.99	1.29
7	090213	09国开13	3,000,000	301,746,291.28	1.14
8	110206	11国开06	3,000,000	300,289,375.68	1.14
9	130214	13国开14	3,000,000	299,680,922.23	1.14
10	130215	13国开15	3,000,000	299,636,336.97	1.14

7.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.2291%
报告期内偏离度的最低值	-0.0786%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1792%

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

7.8.2

本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

7.8.3

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。

7.8.4 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	-
2	应收证券清算款	382,651,043.56
3	应收利息	335,184,392.43
4	应收申购款	325,553,271.43
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,043,388,707.42

§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
南方现金增利货币A	405,260	50,604.49	779,119,923.89	3.80%	19,728,856,625.52	96.20%
南方现金增利货币B	352	16,646,591.27	4,821,669,092.03	82.29%	1,037,931,034.92	17.71%
合计	405,612	65,006.89	5,600,789,015.92	21.24%	20,766,787,660.44	78.76%

注: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(即期末基金份额总额)。

8.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方现金增利货币A	33,033,824.64	0.1611%
	南方现金增利货币B	-	-
	合计	33,033,824.64	0.1253%

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未持有本基金A/B类份额,本基金基金经理持有本基金A/B类份额的数量区间为100万份以上。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	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)基金份额总额	8,049,850,114.32	-
本报告期期初基金份额总额	25,854,819,911.25	23,075,115,551.35
本报告期基金总申购份额	66,825,795,142.34	51,779,692,991.76
减:本报告期基金总赎回份额	72,172,638,504.18	68,995,208,416.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,507,976,549.41	5,859,600,126.95

§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

报告期内本基金投资策略未改变。

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	
银河证券	2	-	-	-	-	-

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
银河证券	-	-	-	-	-	-

注:1、本期无租用证券公司交易单元的变更情况。

2、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。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注:无。