

南方理财 60 天债券型证券投资基金 2014 年半年度报告（摘要）

2014 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：2014 年 8 月 26 日

§ 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

| | | |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称 | 南方理财 60 天债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 南方理财 60 天债券 | |
| 基金主代码 | 202305 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012 年 10 月 19 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 | 958,472,714.33 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 南方理财 60 天债券 A | 南方理财 60 天债券 B |
| 下属分级基金的交易代码: | 202305 | 202306 |
| 报告期末下属分基基金的份额总额 | 902,820,723.01 份 | 55,651,991.32 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“南方理财 60 天”。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在 180 天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款税后利率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金。 |

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 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com |
| 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 | 南方理财 60 天债券 A | 南方理财 60 天债券 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 | 16,401,978.22 | 987,993.34 |
| 本期利润 | 16,401,978.22 | 987,993.34 |
| 本期净值收益率 | 2.6592% | 2.8049% |
| 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 | 902,820,723.01 | 55,651,991.32 |
| 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,由于本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。

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

南方理财 60 天债券 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 | 0.4250% | 0.0068% | 0.1126% | 0.0000% | 0.3124% | 0.0068% |
| 过去三个月 | 1.2310% | 0.0065% | 0.3418% | 0.0000% | 0.8892% | 0.0065% |
| 过去六个月 | 2.6592% | 0.0072% | 0.6810% | 0.0000% | 1.9782% | 0.0072% |
| 过去一年 | 5.1913% | 0.0061% | 1.3781% | 0.0000% | 3.8132% | 0.0061% |
| 自基金合同成立以来 | 8.0875% | 0.0073% | 2.3522% | 0.0000% | 5.7353% | 0.0073% |

南方理财 60 天债券 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 | 0.4486% | 0.0068% | 0.1126% | 0.0000% | 0.3360% | 0.0068% |
| 过去三个月 | 1.3034% | 0.0065% | 0.3418% | 0.0000% | 0.9616% | 0.0065% |
| 过去六个月 | 2.8049% | 0.0072% | 0.6810% | 0.0000% | 2.1239% | 0.0072% |
| 过去一年 | 5.4937% | 0.0061% | 1.3781% | 0.0000% | 4.1156% | 0.0061% |
| 自基金合同 | 8.6208% | 0.0074% | 2.3522% | 0.0000% | 6.2686% | 0.0074% |

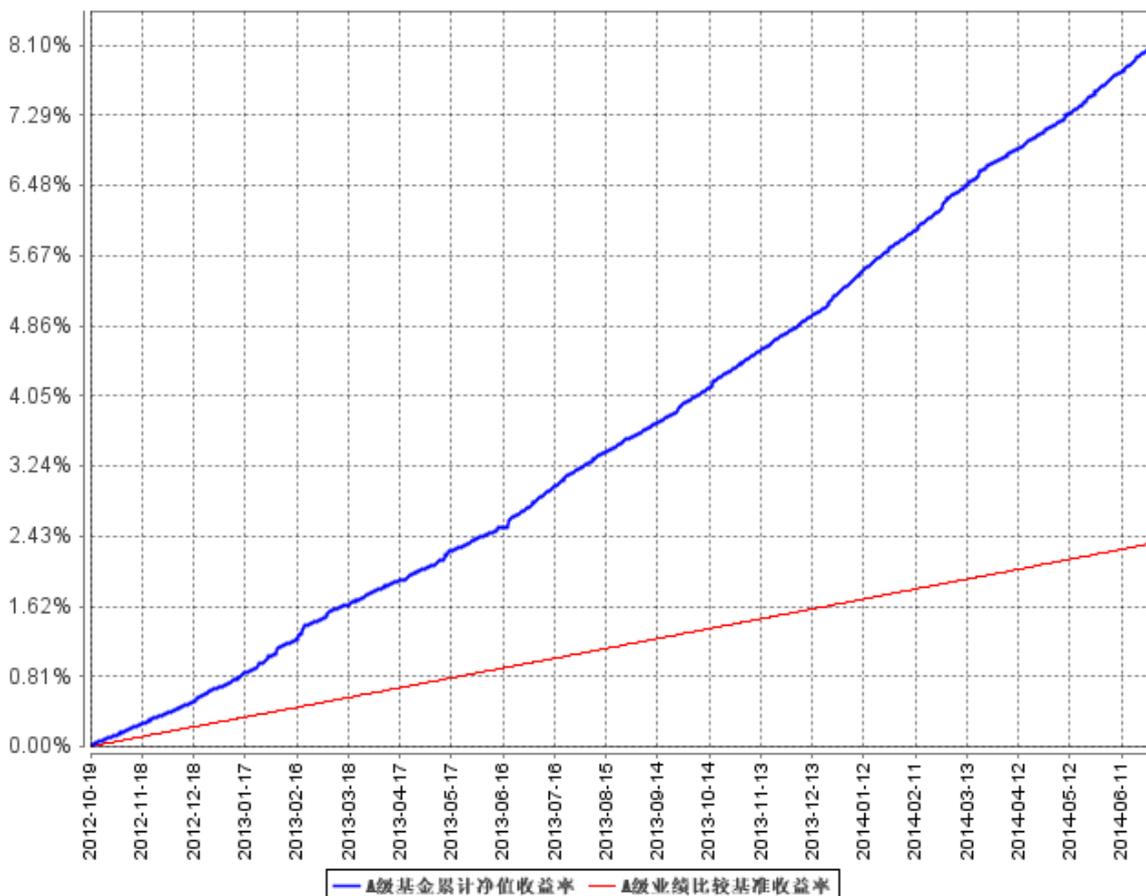
| | | | | | | |
|------|--|--|--|--|--|--|
| 成立以来 | | | | | | |
|------|--|--|--|--|--|--|

注：1、本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期末集中支付。

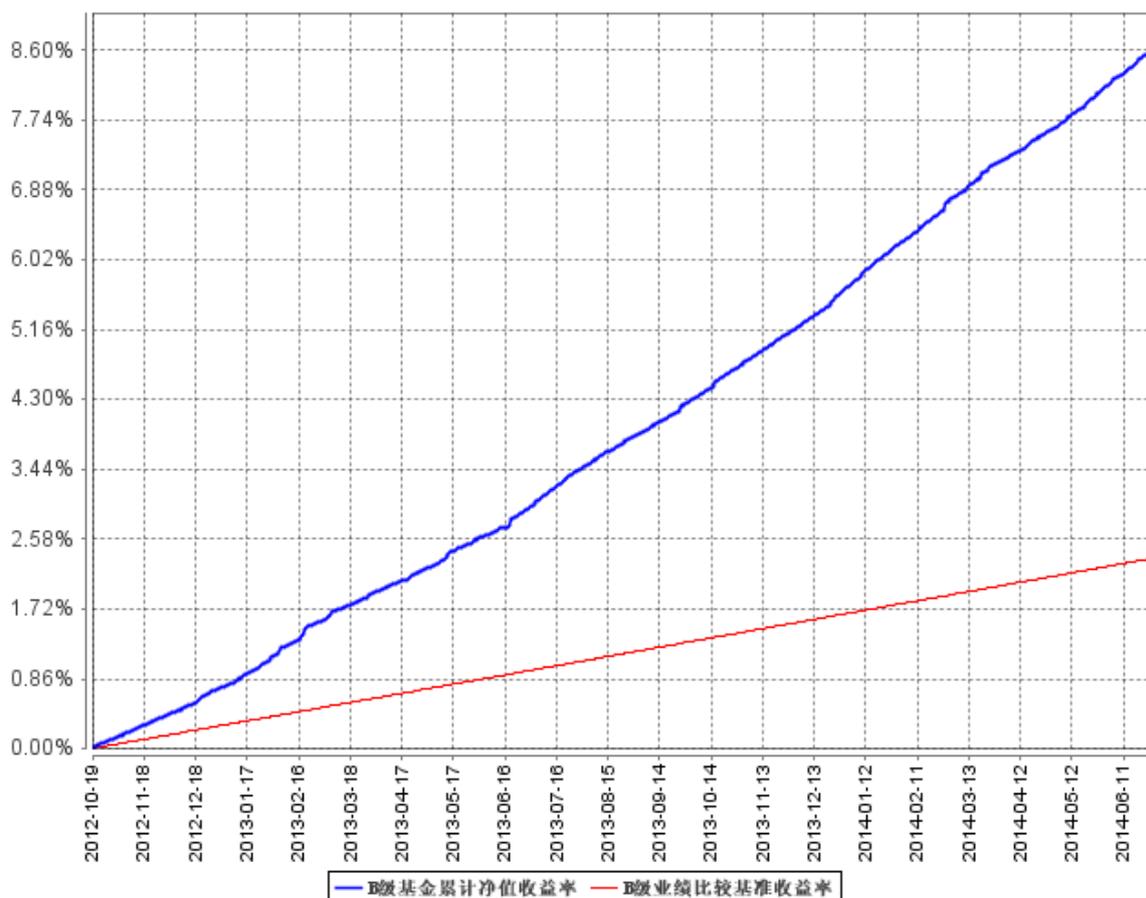
2、本基金计算份额净值收益率时所选取的运作周期，是以基金合同生效日为起始日并持有至报告期末的基金份额所经历的运作周期。

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本基金合同生效之日起 60 天，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 | | |
| 夏晨曦 | 本基金基金经理 | 2012-10-19 | - | 9 | 香港科技大学理学硕士，具有基金从业资格。2005 年 5 月加入南方基金，曾担任金融工程研究员、固定收益研究员、风险控制员等职务，现任固定收益部总监助理。2008 年 5 月至 2012 年 7 月，任固定收益部投资经理，负责社保、专户及年金组合的投资管理；2012 年 7 月至今，任南方润元基金经理；2012 年 8 月至今，任南方理财 14 天基金经理；2012 年 10 月至今，任南方理财 60 天基金经理；2013 年 1 月至今，任南方理财 30 天基金经理。 |

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，“离职日期”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合规守信情况的说明

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、《南方理财 60 天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

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 85BP，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。上半年本基金采取了相对积极的配置策略，在曲线下行过程中维持了相对较高的久期和仓位，并对短融资产进行灵活操作，获取短期价差收益。

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 2.6592%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。B 级基金净值收益率为 2.8049%，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。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。本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稳定静态收益，并积极灵活把握市场波段操作。

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、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，本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。本报告期内应分配收益 17,389,971.56 元，实际分配收益 17,389,971.56 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理财 60 天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，南方理财 60 天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理财 60 天债券型证券投资基金的投资运作、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，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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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理财 60 天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：南方理财 60 天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 | 483,175,413.65 | 323,128,553.07 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 450,623,966.50 | 184,697,322.22 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 435,624,272.79 | 184,697,322.22 |
| 资产支持证券投资 | 14,999,693.71 | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 175,932,023.90 | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 10,728,331.73 | 4,460,903.83 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 15,905,609.14 | 16,146,151.39 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,136,365,344.92 | 528,432,930.51 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2014 年 6 月 30 日 | 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 | 173,064,194.47 | 76,121,231.88 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 186,594.87 | 123,423.27 |
| 应付托管费 | 55,287.39 | 36,569.89 |
| 应付销售服务费 | 196,287.41 | 123,831.04 |
| 应付交易费用 | 23,543.35 | 21,165.52 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 77,244.41 | 26,513.79 |

| | | |
|---------------|------------------|----------------|
| 应付利润 | 4,057,599.41 | 1,759,819.98 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 231,879.28 | 226,800.00 |
| 负债合计 | 177,892,630.59 | 78,439,355.37 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 958,472,714.33 | 449,993,575.14 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 958,472,714.33 | 449,993,575.14 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,136,365,344.92 | 528,432,930.51 |

注：1. 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 958,472,714.33 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 902,820,723.01 份，B 类基金份额的份额总额为 55,651,991.32 份。

6.2 利润表

会计主体：南方理财 60 天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 | 21,241,716.19 | 22,647,324.31 |
| 1.利息收入 | 18,316,965.47 | 17,435,375.08 |
| 其中：存款利息收入 | 12,324,841.70 | 10,109,985.21 |
| 债券利息收入 | 4,370,440.64 | 4,754,402.70 |
| 资产支持证券利息收入 | 71,878.64 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 1,549,804.49 | 2,570,987.17 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 2,914,750.72 | 5,211,949.23 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 2,914,750.72 | 5,211,949.23 |
| 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） | 10,000.00 | - |
| 减：二、费用 | 3,851,744.63 | 4,238,458.25 |
| 1. 管理人报酬 | 898,120.83 | 1,231,122.68 |
| 2. 托管费 | 266,109.88 | 364,777.23 |

| | | |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 3. 销售服务费 | 945,892.62 | 1,187,649.54 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 1,515,066.02 | 1,194,570.41 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 1,515,066.02 | 1,194,570.41 |
| 6. 其他费用 | 226,555.28 | 260,338.39 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 17,389,971.56 | 18,408,866.06 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 17,389,971.56 | 18,408,866.06 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方理财 60 天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） | 449,993,575.14 | - | 449,993,575.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 17,389,971.56 | 17,389,971.56 |
| 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） | 508,479,139.19 | - | 508,479,139.19 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,305,230,367.13 | - | 1,305,230,367.13 |
| 2. 基金赎回款 | -796,751,227.94 | - | -796,751,227.94 |
| 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） | - | -17,389,971.56 | -17,389,971.56 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 958,472,714.33 | - | 958,472,714.33 |
| 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） | 813,954,862.33 | - | 813,954,862.33 |

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，应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

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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | 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 | 898,120.83 | 1,231,122.68 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 357,668.87 | 510,617.92 |

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 0.27% 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 0.27% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | 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 | 266,109.88 | 364,777.23 |

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 0.08% 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 0.08% / 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 | | |
| | 南方理财 60 天债券 A | 南方理财 60 天债券 B | 合计 |
| 工商银行 | 96,655.65 | 83.57 | 96,739.22 |
| 华泰证券 | 4,775.64 | 0.00 | 4,775.64 |
| 南方基金 | 61,739.05 | 298.83 | 62,037.88 |
| 兴业证券 | 7.75 | 0.00 | 7.75 |
| 合计 | 163,178.09 | 382.40 | 163,560.49 |
| 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 | | |
| | 南方理财 60 天债券 A | 南方理财 60 天债券 B | 合计 |
| 工商银行 | 647,526.57 | 3,262.00 | 650,788.57 |
| 华泰证券 | 6,132.96 | 507.14 | 6,640.10 |
| 南方基金 | 89,870.78 | 689.52 | 90,560.30 |
| 兴业证券 | 606.38 | 0.00 | 606.38 |
| 合计 | 744,136.69 | 4,458.66 | 748,595.35 |

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 南方基金管理有限公司，再由 南方基金管理有限公司 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 0.30% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 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

注：无。

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

注：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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------|----------|----------------------|-----------|
| | 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 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 | 1,175,413.65 | 7,674.17 | 26,796,037.07 | 13,724.89 |

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

注：无。

6.4.6 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

注：无。

6.4.6.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.6.1.1 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 173,064,194.47 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 |
|-----------|--------------|------------|--------|---------|---------------|
| 130236 | 13 国开 36 | 2014-07-01 | 99.96 | 500,000 | 49,980,437.13 |
| 041454018 | 14 华能集 CP001 | 2014-07-03 | 100.50 | 200,000 | 20,099,195.53 |
| 011419004 | 14 国电 SCP004 | 2014-07-03 | 99.85 | 200,000 | 19,970,929.35 |
| 041359052 | 13 云投 CP001 | 2014-07-04 | 100.99 | 190,000 | 19,188,720.73 |
| 130235 | 13 国开 35 | 2014-07-01 | 98.27 | 145,000 | 14,248,669.38 |

| | | | | | |
|-----------|---------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 041451011 | 14 晋煤 CP001 | 2014-07-03 | 100.01 | 100,000 | 10,000,858.98 |
| 041461035 | 14 绍兴城投 CP002 | 2014-07-03 | 100.00 | 100,000 | 10,000,133.84 |
| 041464032 | 14 青岛城投 CP001 | 2014-07-03 | 100.00 | 100,000 | 10,000,130.68 |
| 041451032 | 14 电网 CP001 | 2014-07-03 | 99.82 | 100,000 | 9,982,280.64 |
| 011410004 | 14 中电投 SCP004 | 2014-07-03 | 99.79 | 100,000 | 9,978,814.51 |
| 合计 | | | | 1,735,000 | 173,450,170.77 |

6.4.6.1.2 交易所市场债券正回购

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 | 450,623,966.50 | 39.65 |
| | 其中：债券 | 435,624,272.79 | 38.33 |
| | 资产支持证券 | 14,999,693.71 | 1.32 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 175,932,023.90 | 15.48 |
| | 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 | 483,175,413.65 | 42.52 |
| 4 | 其他各项资产 | 26,633,940.87 | 2.34 |
| 5 | 合计 | 1,136,365,344.92 | 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 | | 12.92 |
| | 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 | 173,064,194.47 | 18.06 |
| | 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：本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

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 | 133 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 150 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 73 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

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 | 23.67 | 18.06 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.54 | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 18.09 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 20.79 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—180 天 | 19.84 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180 天(含)—397 天(含) | 33.39 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 115.78 | 18.06 |

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 | 64,720,439.94 | 6.75 |
| | 其中：政策性金融债 | 64,720,439.94 | 6.75 |
| 4 | 企业债券 | - | - |

| | | | |
|---|----------------------|----------------|-------|
| 5 | 企业短期融资券 | 370,903,832.85 | 38.70 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 435,624,272.79 | 45.45 |
| 9 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 14,740,002.81 | 1.54 |

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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 | 130236 | 13 国开 36 | 500,000 | 49,980,437.13 | 5.21 |
| 2 | 041359052 | 13 云投 CP001 | 400,000 | 40,397,306.80 | 4.21 |
| 3 | 041364036 | 13 鄂联投 CP002 | 300,000 | 30,328,743.24 | 3.16 |
| 4 | 041454018 | 14 华能集 CP001 | 200,000 | 20,099,195.53 | 2.10 |
| 5 | 011410003 | 14 中电投 SCP003 | 200,000 | 20,017,382.32 | 2.09 |
| 6 | 041452012 | 14 铁道 CP001 | 200,000 | 20,006,752.04 | 2.09 |
| 7 | 041451034 | 14 大国资 CP001 | 200,000 | 20,000,872.78 | 2.09 |
| 8 | 041361045 | 13 沪电力 CP001 | 200,000 | 20,000,802.52 | 2.09 |
| 9 | 011419004 | 14 国电 SCP004 | 200,000 | 19,970,929.35 | 2.08 |
| 10 | 130235 | 13 国开 35 | 150,000 | 14,740,002.81 | 1.54 |

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 | 0.2453% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.1105% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1283% |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|---------------|------------|---------------|--------------|
| 1 | 1489035 | 14 开元 3A1(总价) | 150,000.00 | 14,999,693.71 | 1.56 |

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 | - |
| 3 | 应收利息 | 10,728,331.73 |
| 4 | 应收申购款 | 15,905,609.14 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 26,633,940.87 |

§ 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 |
| 南方理财 60 天债券 A | 19,373 | 46,602.01 | 563,160.46 | 0.06% | 902,257,562.55 | 99.94% |
| 南方理财 60 天债券 B | 6 | 9,275,331.89 | 40,600,931.12 | 72.96% | 15,051,060.20 | 27.04% |
| 合计 | 19,379 | 49,459.35 | 41,164,091.58 | 4.29% | 917,308,622.75 | 95.71% |

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 | 南方理财 60 天债券 A | 839, 123. 27 | 0. 0929% |
| | 南方理财 60 天债券 B | - | - |
| | 合计 | 839, 123. 27 | 0. 0875% |

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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|---------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 南方理财 60 天债券 A | 10~50 |
| | 南方理财 60 天债券 B | - |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 南方理财 60 天债券 A | - |
| | 南方理财 60 天债券 B | - |
| | 合计 | - |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 南方理财 60 天债券 A | 南方理财 60 天债券 B |
|-------------------------------------|----------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2012 年 10 月 19 日） 基金份额总额 | 4, 538, 810, 563. 05 | 569, 578, 392. 37 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 413, 912, 825. 86 | 36, 080, 749. 28 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1, 231, 618, 885. 49 | 73, 611, 481. 64 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 742, 710, 988. 34 | 54, 040, 239. 60 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 902, 820, 723. 01 | 55, 651, 991. 32 |

§ 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

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

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。

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

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 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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:本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。