

# 南方理财60天债券型证券投资基金

## [2012] 第四季度报告

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  
报告送出日期:2013年1月21日

### 重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

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1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称 南方理财60天债券

交易代码 202305

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年10月19日

报告期末基金份额总额 813,954,862.33份

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。

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，提高基金资产的40%。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2012年10月19日 - 2012年12月31日)
南方理财60天债券A		南方理财60天债券B

1. 本期已实现收益 24,903,543.15 3,408,686.88

2.本期利润 24,903,543.15 3,408,686.88

3.期末基金资产净值 718,363,693.42 95,591,168.91份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示栏及其他信息披露场合下,可简称为“南方理财60天”。

### § 3.2 主要财务指标和基金净值表现

南方理财 60 天债券 A

阶段 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.666% 0.000% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.666% 0.000% 0.3907% 0.0030%

南方理财 60 天债券 B

阶段 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.309% 0.004% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.309% 0.004% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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

3.2.3 基金合同生效以来基金累计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 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.309% 0.004% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.309% 0.004% 0.3907% 0.0030%

南方理财 60 天债券 B

阶段 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.666% 0.000% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.666% 0.000% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.309% 0.004% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.309% 0.004% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 B

阶段 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.666% 0.000% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.666% 0.000% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.309% 0.004% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.309% 0.004% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 B

阶段 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.666% 0.000% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.666% 0.000% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.309% 0.004% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.309% 0.004% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 B

阶段 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.666% 0.000% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.666% 0.000% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.309% 0.004% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.309% 0.004% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 B

阶段 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.666% 0.000% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.666% 0.000% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.309% 0.004% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.309% 0.004% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 B

阶段 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.666% 0.000% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.666% 0.000% 0.4530% 0.0034%

注:1.本基金每日计算当年收益并分配,并在工作期末集中支付。

2.本基金计算份额净值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的运作周期。

3.2.3 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

3.2.4 基金合同生效以来基金累计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 净值收益率(%) 业绩比较基准收益率(%)

(1) 0.309% 0.004% 0.2779% 0.0000%

(过去三个月) 0.309% 0.004% 0.4530% 0.0034%